Schweizerische Eidgenossenschaft
Confédération suisse
Confederazione Svizzera
Confederaziun svizra

Eidgenössisches Finanzdepartement EFD
Département fédéral des finances DFF
Dipartimento federale delle finanze DFF

Eidgenössische Steuerverwaltung ESTV
Administration fédérale des contributions AFC
Amministrazione federale delle contribuzioni AFC

KURSLISTE Band 1

In der Schweiz kotierte in- und ausländische Wertpapiere

LISTE DES COURS Volume 1

Titres suisses et étrangers cotés en Suisse

LISTINO DEI CORSI Volume 1

Titoli svizzeri ed esteri quotati in Svizzera

31. 12. 2017

Fr. 25.00 inkl./incl. MWST/TVA/IVA für beide Bände/pour les deux volumes/per i due volumi

Auskünfte / Renseignements / Informazioni:
Anlagefonds / Fonds de placement / Fondi d'investimento: 058 462 73 78 / 058 462 71 17
Derivative Produkte / Produits dérivés / Strumenti derivati: 058 462 71 31 / 058 462 71 16
Obligationen / Obligations / Obbligazioni: 058 462 71 16
Aktien/Gratis-Aktien / Actions/Actions gratuites / Azioni/Azioni gratuite: 058 462 71 34 / 058 462 58 79

Vertrieb:
BBL, Verkauf Bundespublikationen, CH-3003 Bern
Fax: 058 465 50 58, Internet: www.bundespublikationen.admin.ch
Art.-Nr. 605.050.30/17

Distribution:
OFCL, Vente des publications fédérales, CH-3003 Berne
Fax: 058 465 50 58, Internet: www.bundespublikationen.admin.ch
Art.-Nr. 605.050.30/17

Distribuzione:
UFCL, Vendita di pubblicazioni federali, CH-3003 Berna
Fax: 058 465 50 58, Internet: www.bundespublikationen.admin.ch
Art.-Nr. 605.050.30/17

Internet: www.estv.admin.ch

Inhaltsverzeichnis - Table des matières - Indice

Bemerkungen / Observations / Osservazioni			2 - 3
Bank-Kassen-Obligationen / Bons de caisse des banques / Obbligazioni di cassa bancarie			4
Abkürzungen / Abréviations / Abbreviazioni			5
Zeichenerklärung / Explication des signes / Spiegazioni dei segni			6 - 7
Namensänderungen / Changements de nom / Cambio dei nomi			8 - 9
Schweiz Suisse Svizzera	Aktien / Actions / Azioni		10 - 39
	Anleihen / Emprunts / Obbligazioni	Obligationen / Obligations / Obbligazioni	40 - 75
		Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili	76 - 82
	Derivative Finanzinstrumente Produits financiers dérivés Strumenti finanziari derivati	Anlagefondsähnliche Vermögen Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni	83 - 96
		Index- und Basketzertifikate Certificats sur un indice ou un panier d'actions Certificati d'indice e di basket	97 - 107
		Kombinierte Produkte Produits combinés Prodotti combinati	108 - 229
Ausland Etranger Estero	Aktien / Actions / Azioni		230 - 286
	Anleihen / Emprunts / Obbligazioni	Obligationen / Obligations / Obbligazioni	287 - 412
		Optionsanleihen / Emprunts à option / Obbligazioni a opzione	413
		Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili	414 - 432
	Derivative Finanzinstrumente Produits financiers dérivés Strumenti finanziari derivati	Anlagefondsähnliche Vermögen Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni	433 - 449
		Index- und Basketzertifikate Certificats sur un indice ou un panier d'actions Certificati d'indice e di basket	450 - 469
		Kombinierte Produkte (A-G) Produits combinés (A-G) Prodotti combinati (A-G)	470 - 766
Devisen - Banknoten / Devises - Billets de banque / Divise - Biglieti di banca			767 - 768
Goldmünzen und Edelmetalle / Monnaies d'or et métaux précieux / Monete d'oro e metalli preziosi			769
Devisen - Jahresmittelkurse in der Schweiz Cours annuels moyens des devises en Suisse Corsi annui medi delle divise in Svizzera			770
Doppelbesteuerungsabkommen / Conventions en vue d'éviter les doubles impositions / Convenzioni intese ad evitare le doppie imposizioni			771 - 772

Bemerkungen

Die in der Kursliste der ESTV enthaltenen Kurse sind in der Regel die Schlusskurse des letzten Börsentages des Monats Dezember (Quelle: SIX Financial Information). Bei fehlenden Kursen wird auf die letztverfügbaren Kurse zurückgegriffen. Diese Kurse gelten als Steuerwert am **31. Dezember 2017** (Art. 13 und 14, Abs. 1 StHG).

Bei der Titelgruppe „Aktien Ausland" kann es in einzelnen Fällen zu beträchtlichen Abweichungen zwischen den Kursen der SIX SX und den Heimbörsen der Titel kommen; insbesondere dann, wenn für die ausländischen Aktien an der SIX SX kein liquider Handel besteht. Weichen die Kurse der SIX SX zu stark (10% und mehr) von denjenigen der Heimbörsen ab, behalten sich SIX Financial Information und die ESTV vor, auf Kurse von Börsenplätzen mit liquidem Handel zurückzugreifen. Für die Umrechnung dieser Kurse in Schweizerfranken sind die Kurse für freie Devisen massgebend.

Ende Januar bzw. anfangs Februar wird das finale Steuerkursfile von SIX Financial Information mittels VDFS Fiscal Price File an die Datenbezüger übermittelt. Bis zu diesem Zeitpunkt sind SIX Financial Information und die ESTV bestrebt, eine Übereinstimmung der Titelbestände zu gewährleisten, danach ist aber nicht auszuschliessen, dass es zu Abweichungen zwischen den Titelbeständen der SIX Financial Information und der ESTV kommen kann.

Für die Festlegung des Steuerwertes der **ausschliesslich an ausländischen Börsen kotierten ausländischen Wertschriften** sind die bezahlten Kurse per Ende Dezember 2017 massgebend. In Ermangelung solcher Kursnotizen gelten im allgemeinen die letztbekannten Geldkurse. Für die Umrechnung in Schweizer Franken ist der "Kurs für freie Devise" anzuwenden.

Gratisaktien sowie **Gratisnennwerterhöhungen** sind in der Kursliste als Ertrag aufgeführt, weil sie bei der direkten Bundessteuer und auch bei einzelnen kantonalen Steuern als Einkommen anzugeben sind. Die angegebenen steuerbaren Erträgnisse beziehen sich auf **je eine alte Aktie.**

Bezugsrechte und Kapitalgewinne: Der Erlös aus Bezugsrechten sowie die Kapitalgewinne aus der Veräusserung von Wertpapieren sind steuerfrei, sofern die Vermögensrechte zum Privatvermögen gehören.

Nichtkotierte, d.h. an der Börse nicht offiziell gehandelte Wertpapiere sind zum Verkehrswert (Steuerwert) am 31. Dezember 2017 zu deklarieren. Wenn dieser im Zeitpunkt der Abgabe der Steuererklärung nicht bekannt ist, so kann, unter Vorbehalt der Berichtigung durch die Veranlagungsbehörde, der letztbekannte Steuerwert eingesetzt werden (Wert am 31. Dezember 2016).

Der ordentliche **Kapitalisierungszinsfuss** per 31. Dezember 2017 wurde auf 7.0% festgesetzt und derjenige für die Aktien von Bank- und Versicherungsunternehmungen auf 7.0% (vgl. Wegleitung zur Bewertung von Wertpapieren ohne Kurswert für die Vermögenssteuer, Kreisschreiben Nr. 28 vom 28.8.2008, Randziffer 10).

Die Eidg. Steuerverwaltung ist bestrebt, das umfangreiche Datenmaterial vollständig zu verarbeiten und zu publizieren. Trotzdem kann es zu fehlenden oder fehlerhaften Angaben in der Kursliste kommen. In solchen Fällen bleibt eine entsprechende Berücksichtigung oder Korrektur in den Veranlagungsverfahren vorbehalten.

Observations

Les cours figurant sur la liste des cours de l'AFC sont en règle générale les cours en vigueur à la clôture du dernier jour d'ouverture de la bourse au mois de décembre (source: SIX Financial Information). Si des cours manquent ce jour-là, on se base sur les derniers cours disponibles. Ces cours tiennent lieu de valeur fiscale au **31 décembre 2017** (Art. 13 et 14, 1er al. LHID)**.**

Pour le groupe des actions étrangères, il peut y avoir dans certains cas des écarts considérables entre les cours de la SIX SX et ceux des bourses d'origine du titre, en particulier lorsqu'il n'existe pas de marché liquide à la SIX SX pour les actions étrangères. Si les cours de la SIX SX s'écartent trop (10% ou plus) de ceux des bourses indigènes, SIX Financial Information et l'AFC se réservent le droit de recourir aux cours des bourses qui ont un marché liquide. Ces cours sont calculés en francs suisses selon le cours des devises.

A la fin du mois de janvier/début du mois de février, le dernier document sur le cours d'évaluation fiscale de SIX Financial Information sera transmis aux bénéficiaires des données au moyen de VDFS Fiscal Price File. Jusqu'à cette date, SIX Financial Information et l'AFC sont tenus de garantir une correspondance entre les titres que chacun possède ; ensuite, il n'est pas exclu qu'apparaissent des écarts entre l'ensemble des titres de SIX Financial Information et ceux de l'AFC.

Pour déterminer la valeur imposable des **titres étrangers exclusivement cotés à des bourses étrangères**, on tiendra compte des cours payés à fin décembre 2017. A défaut de tels cours, on appliquera généralement les derniers cours de la demande. La conversion en francs suisses a lieu au "cours des devises libres".

Les actions gratuites, ainsi que **les augmentations gratuites de la valeur nominale** sont indiquées comme rendement dans la liste des cours, car elles doivent être déclarées comme revenu pour l'impôt fédéral direct, ainsi que pour certains impôts cantonaux. Les rendements imposables figurant dans cette liste sont indiqués **pour une action ancienne**.

Droits de souscription et bénéfices en capital: le produit de l'aliénation de droits de souscription ainsi que les gains en capital réalisés lors de l'aliénation de titres ne sont pas imposables lorsque les droits patrimoniaux font partie de la fortune privée du contribuable.

Les **titres non cotés**, c'est-à-dire non officiellement négociés en Bourse, doivent être déclarés à leur valeur vénale (valeur fiscale) au 31 décembre 2017; si celle-ci n'est pas connue lors de la remise de la déclaration d'impôt, on peut indiquer, sous réserve de rectification par les autorités de taxation, la dernière valeur imposable connue (valeur au 31 décembre 2016).

Le **taux de capitalisation** ordinaire au 31 décembre 2017 a été fixé à 7.0%, et celui pour les actions de sociétés bancaires et d'assurances, à 7.0% (cf. "instructions concernant l'estimation des titres non cotés en vue de l'impôt sur la fortune", circulaire n°28 du 28.8.2008, no 10).

L'Administration fédérale des contributions s'efforce de publier des données complètes et détaillées. Toutefois, il est possible que des lacunes ou des erreurs apparaissent dans la liste des cours. Dans ces cas, des compléments ou des corrections au cours de la procédure de taxation restent réservées.

Osservazioni

Il listino dell'AFC contiene di regola i corsi di chiusura dell'ultimo giorno di Borsa del mese di dicembre (fonte: SIX Financial Information) e, in loro mancanza, i dati degli ultimi corsi a disposizione. Questi valgono quale valore fiscale al **31 dicembre 2017** (art. 13 e 14 cpv. 1 LAID**)**.

In singoli casi, nel gruppo di titoli "Azioni estere" possono presentarsi notevoli variazioni tra i corsi del SIX SX e i corsi della Borsa svizzera dei titoli, segnatamente quando per le azioni estere alla SIX SX non esiste mercato liquido. Se i corsi della SIX SX si scostano troppo da quelli della Borsa svizzera (10% e oltre), SIX Financial Information e l'AFC si riservano il diritto di basarsi sui corsi delle piazze borsistiche con mercato liquido. Per la conversione di questi corsi in franchi svizzeri sono determinanti i corsi delle valute libere.

Alla fine di gennaio rispettivamente all'inizio di febbraio il file finale del corso fiscale di SIX Financial Information verrà trasmesso agli utenti mediante VDFS Fiscal Price File. Sino ad allora SIX Financial Information e l'AFC si sforzano di garantire una concordanza degli stock di titoli, in seguito non è tuttavia da escludere che possano sussistere scostamenti tra gli stock di titoli del SIX Financial Information e dell'AFC.

Per determinare il valore imponibile dei **titoli stranieri quotati esclusivamente nelle borse estere**, fanno stato i corsi pagati a fine dicembre 2017. In mancanza di tali corsi si applicheranno, generalmente, gli ultimi corsi della domanda. La conversione in franchi svizzeri si effettua sulla base del "corso delle divise libere".

Le azioni gratuite, nonchè **gli aumenti gratuiti del valore nominale** figurano come reddito nel listino dei corsi, dato che ai fini dell'imposta federale diretta ed anche per alcune imposte cantonali essi vanno indicati come reddito. I redditi imponibili che figurano nel listino dei corsi sono indicati per **una vecchia azione**.

Diritti di opzione e utili in capitale: Il ricavo dall'alienazione di diritti di opzione nonché gli utili in capitale conseguiti nella realizzazione di cartevalori sono esenti da imposta, a condizione che i diritti patrimoniali appartengono alla sostanza privata.

I titoli non quotati, ossia non trattati ufficialmente in borsa, devono essere dichiarati secondo il valore venale (valore fiscale) al 31 dicembre 2017; se al momento della consegna della dichiarazione d'imposta esso non è conosciuto, si può indicare, riservata la rettificazione da parte delle autorità di tassazione, l'ultimo valore imponibile conosciuto (valore al 31 dicembre 2016).

L'aliquota di capitalizzazione ordinaria al 31 dicembre 2017 è stata fissata al 7.0% e per le azioni di società bancarie e di assicurazioni al 7.0% (v. "Istruzioni relative alla valutazione dei titoli senza corso ai fini dell'imposta sulla sostanza", circolare n°28 per 28.8.2008, n. 10).

L'Amministrazione federale delle contribuzioni si sforza di pubblicare dati completi e dettagliati. Tuttavia, è possibile che delle lacune o degli errori appaiano nel listino dei corsi. In questi casi restano riservati dei complementi o delle correzioni nel corso della procedura di tassazione.

Bank-Kassen-Obligationen / Bons de caisse des banques / Obbligazioni di cassa bancarie

Diese sind wie folgt zu bewerten: / Ceux-ci doivent être estimés comme suit: / Questi vanno valutate come segue:

Fälligkeit/échéance/scadenza %	1.1.18 - 30.6.18 %	1.7.18 - 30.6.19 %	1.7.19 - 30.6.20 %	1.7.20 - 30.6.21 %	1.7.21 - 30.6.22 %	1.7.22 - 30.6.23 %	1.7.23 - 30.6.24 %	1.7.24 - 30.6.25 %	1.7.25 - 30.6.26 %
¼ und höher/et plus/ed oltre	100.000	100.000	100.000	100.000	100.000	100.000	100.000	100.000	100.000
0.2	100.000	99.950	99.900	99.850	99.800	99.750	99.700	99.650	99.600
0.125	100.000	99.875	99.750	99.625	99.500	99.375	99.250	99.125	99.000
0.1	100.000	99.850	99.700	99.550	99.400	99.250	99.100	98.950	98.800
usw.									

Abkürzungen / Abréviations / Abbreviazioni

Anr.	=	Anrecht/droit/diritto
B.V.	=	Bezugsverhältnis/droit de souscription/diritto di opzione
Cp.	=	Coupon/coupon/cedola
Em.	=	Emission/émission/emissione
IUP	=	Besteuerung gemäss Art. 20 Abs. 1 Buchstabe b DBG (vgl. Kreisschreiben Nr. 15 vom 3.10.2017)
		Imposition selon l'art. 20 1er alinéa lettre b, LIFD (cf. circulaire no 15 du 3.10.2017)
		Imposizione justa art. 20 cpv. 1 lett. b, LIFD (v. circolare n. 15 del 3.10.2017)
jce	=	dividendenberechtigt/jouissance/godimento
KG	=	Kapitalgewinn/bénéfice en capital/utili di capitale
n.v.	=	nicht verfügbar/non disponible/non disponibile
PS	=	Partizipationsschein/bon de participation/buono di partecipazione
remb.	=	zurückbezahlt/remboursé/rimborsato

Zeichenerklärung / Explication des signes / Spiegazione dei segni

(B) Bonus
Bonus
Bonus

(E) Anspruch auf die Dividenden haben diejenigen Personen, die am Tage vor der Ex-Notierung Besitzer solcher Aktien waren.
Seules les personnes possédant de telles actions la veille de la cotation ex-dividende ont droit au paiement de ces dividendes.
Hanno diritto ai dividendi le persone, che il giorno precedente la quotazione ex-dividendo possedevano le relative azioni.

(G) Verrechnungssteuerfreier Kapitalgewinn
Bénéfice en capital non soumis à l'impôt anticipé
Utili di capitale non assoggettati all'imposta preventiva

(H) Anlagefonds mit direktem Grundbesitz
Fonds de placement avec immeubles en propriété directe
Fondo d'investimento con possesso fondiario diretto

(I) Der steuerbare Ertrag konnte noch nicht ermittelt werden und wird später festgesetzt.
Le rendement imposable n'a pas encore pu être déterminé et sera fixé ultérieurement.
Il reddito imponibile non era ancora accertato, per cui verrà fissato più tardi.

(IK) Die nicht steuerbare KEP-Ausschüttung konnte noch nicht ermittelt werden und wird später festgesetzt.
Le dividende PAC non imposable n'a pas encore pu être déterminé et sera fixé ultérieurement.
Il dividendo non imponibile PAC non era ancora accertato, per cui verrà fissato più tardi.

(IM) Wiederanlage der zurückbehaltenen Erträge spätestens 4 Monate nach Geschäftsabschluss.
Réinvestissement des revenus retenus au plus tard 4 mois après la clôture de l'exercice comptable.
Reinvestimento dei redditi accumulati al più tardi entro 4 mesi dalla chiusura contabile.

KEP Rückzahlung Kapitaleinlagen
Remboursement d'apports de capital
Rimborso da apporti di capitale

(KG) Kapitalgewinn
bénéfice en capital
utili di capitale

(L) Kein Abzug von Verrechnungssteuer
Exempt de l'impôt anticipé
Esente dall'imposta preventiva

(M) Thesaurierungsfonds/Fondsähnliche Vermögen (Schweiz)
Fonds de thésaurisation/ensemble de biens assimilés à un fonds de placement (Suisse)
Fondo di tesaurizzazione/Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni (Svizzera)

(N) Thesaurierungsfonds / Fondsähnliche Vermögen (Ausland)
Fonds de thésaurisation / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement (Etranger)
Fondo di tesaurizzazione / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni (Esterno)

(P) Der Verrechnungssteuer unterliegendes ausländisches Einkommen (Art. 9 Abs. 1 VStG)
Rendement étranger soumis à l'impôt anticipé (art. 9, 1er al. LIA)
Reddito estero assoggettato all'imposta preventiva (art. 9 cpv. 1 LIP)

(Q) Mit ausländischer Quellensteuer
Soumis à l'impôt à la source étranger
Assaggettato all'imposta alla fonte straniera

(V) Die Ausschüttung in Form von Aktien unterliegt nicht der Quellensteuer; es besteht kein Anspruch auf die pauschale Steueranrechnung. Wird die Ausschüttung hingegen bar bezogen, kann grundsätzlich die pauschale Steueranrechnung geltend gemacht werden.

Le paiement sous forme d'actions n'est pas soumis à l'impôt à la source; il n'y a, par conséquent, aucun droit à l'imputation forfaitaire d'impôts. Si le paiement s'effectue en espèce, l'imputation forfaitaire peut en principe être possible.

Il pagamento sotto forma d'azioni non è sottoposto a l'imposta alla fonte; il computo globale non può essere fatto valere. Se il pagamento viene effettuato a contanti, l'imputazione forfetaria, di principio, è possibile.

Zeichenerklärung / Explication des signes / Spiegazione dei segni

(Y) Rückkauf eigener Aktien: die Differenz zwischen Rückkaufspreis der Aktien und deren Nominalwert unterliegt der Verrechnungssteuer; diese Differenz stellt ein steuerbares Einkommen dar.

Rachat de propres actions: la différence entre le prix de rachat des actions et leur valeur nominale est soumise à l'impôt anticipé; cette différence constitue un rendement imposable.

Acquisto di azioni proprie: la differenza tra il prezzo d'acquisto delle azioni ed il loro valore nominale soggiace all'imposta preventiva; questa differenza costituisce reddito imponibile

(Z) Quellensteuerfrei

Non soumis à l'impôt à la source

Esente dall'imposta alla fonte

Namensänderungen - Hinweise / Changements de nom - Renvois / Cambio dei nomi - Indicazioni

Name / nom / nomi	Siehe / voir / vedi
Actavis Funding SCS	Allergan Funding SCS
Aguila 3 SA	Swissport Financing S.a r.l.
Airbus Group Finance BV	Airbus Finance B.V.
Airbus Group Finance BV	Airbus Finance B.V.
Airbus Group SE	Airbus SE
BM&F Bovespa SA Bolsa de Valores, Mercadorias e Futuros	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao
BNP Paribas Arbitrage Issuance BV	BNP Paribas Issuance B.V.
Bank Coop AG	Bank Cler AG
Bell AG	Bell Food Group AG
Boing Group Financing PLC	International Car Wash Group Financing PLC
Celesio AG	McKesson Europe AG
China Development Bank Corporation	China Development Bank
Cliffs Natural Resources Inc	Cleveland-Cliffs Inc
Cosco Corporation (Singapore) Ltd	COSCO Shipping International (Singapore) Co Ltd
Cowen Group Inc	Cowen Inc
Credit Suisse	Credit Suisse AG, Sydney Branch
Credit Suisse	Credit Suisse AG, Sydney Branch
DONG Energy A/S	Orsted
DONG Energy A/S	Orsted
Delhi International Airport Pvt Ltd	Delhi International Airport Ltd
Deutsche Wohnen AG	Deutsche Wohnen SE
Deutsche Wohnen AG	Deutsche Wohnen SE
Dominion Resources Inc	Dominion Energy Inc
Empresa de Energia de Bogota SA ESP	Grupo Energia Bogota SA ESP
Enerji Ltd	Volt Power Group Ltd
Enterprise Inns PLC	Ei Group PLC
Eurazeo SA	Eurazeo SE
FOY Group Ltd	Integrated Green Energy Solutions Ltd
GERCH Development GmbH	SG Development GmbH
Galenica AG	Vifor Pharma AG
Galenica Santé AG	Galenica AG
Gamesa Corporacion Tecnologica SA	Siemens Gamesa Renewable Energy SA
Groupe Eurotunnel S.E	Getlink SE
HE-5 Resources Corp	Fansfrenzy Corporation
HYPO NOE Gruppe Bank AG	HYPO NOE Landesbank fuer Niederoesterreich und Wien AG
HYPO NOE Gruppe Bank AG	HYPO NOE Landesbank fuer Niederoesterreich und Wien AG
Hella KGaA Hueck & Co	HELLA GmbH & Co. KGaA
Hesteel Hong Kong Co Ltd	HBIS Group Hong Kong Co., Limited
ICAP Group Holdings PLC	NEX Group Holdings PLC
Iglo Foods BondCo PLC	Nomad Foods BondCo PLC
Inmobiliaria Colonial, SA	Inmobiliaria Colonial SOCIMI SA
KTG Energie AG	KTG Energie GmbH
KTG Energie GmbH	DAH Energie GmbH
Landis+Gyr Holding AG	Landis+Gyr Group AG
Leonardo - Finmeccanica S.p.A.	Leonardo S.p.a.
Leonardo - Finmeccanica S.p.A.	Leonardo S.p.A.
METALL ZUG AG	Metall Zug AG
METRO Wholesale & Food Specialist AG	METRO AG
MHP S.A.	MHP SE
MLP AG	MLP SE

Namensänderungen - Hinweise / Changements de nom - Renvois / Cambio dei nomi - Indicazioni

Name / nom / nomi	Siehe / voir / vedi
Materiellselskapet AS	Norske tog AS
Metro AG	CECONOMY AG
Metro AG	CECONOMY AG
NV Luchthaven Schiphol	Royal Schiphol Group N.V.
NWT Uranium Corp	Captor Capital Corp
Nanogate AG	Nanogate SE
National Bank of Abu Dhabi	First Abu Dhabi Bank P.J.S.C.
PSI AG für Produkte und Systeme der Informationstechnologie	PSI Software AG
Paragon Group of Companies PLC	Paragon Banking Group PLC
Pfleiderer GmbH	PCF GmbH
QINO CAPITAL PARTNERS AG	QINO AG
Robeco NV	Robeco Global Stars Equities Fund NV
Rudolf Woehrl Aktiengesellschaft	RW Abwicklungs AG
SCA Hygiene AB	Essity AB
SCL Basilisk AG	MV Basilisk AG
SE Swiss Estates AG	Swiss Estates AG
SNP Schneider-Neureither&Partner AG (Schneider-Neureither&Partner AG)	SNP Schneider-Neureither & Partner SE
SNS Bank NV	de Volksbank NV
SVG Capital PLC	Sole Realisation Company PLC
Sancon Resources Recovery Inc	IGS Capital Group Limited
Sangamo Biosciences, Inc.	Sangamo Therapeutics, Inc.
Signal Bay Inc	EVIO Inc
Silver Standard Resources Inc.	SSR Mining Inc.
Silver Wheaton Corp.	Wheaton Precious Metals Corp.
Standard Life PLC	Standard Life Aberdeen PLC
Talvivaara Mining Company Plc	Ahtium Plc
TechnipFMC Limited	TechnipFMC PLC
Tesla Motors Inc	Tesla Inc
Tesla Motors, Inc.	Tesla Inc.
Tessenderlo Chemie NV	Tessenderlo Group N.V.
ThyssenKrupp AG	thyssenkrupp AG
ThyssenKrupp AG	thyssenkrupp AG
Tom Tailor Holding AG	TOM TAILOR Holding SE
Unipol Gruppo Finanziario SpA	Unipol Gruppo S.p.A.
Vangold Resources Ltd	Vangold Mining Corp
VimpelCom Holdings B.V.	VEON Holdings B.V.
Voith GmbH	Voith GmbH & Co. KGaA
Vorarlberger Landes- und Hypothekenbank AG	Hypo Vorarlberg Bank AG
Vorarlberger Landes- und Hypothekenbank AG	Hypo Vorarlberg Bank AG
XING AG	XING SE
XING AG	XING SE
Yahoo! Inc.	Altaba Inc.
fairvesta Europe III Aktiengesellschaft	fv Europe III Aktiengesellschaft
fairvesta Europe III Aktiengesellschaft	fv Europe III Aktiengesellschaft

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
5EL SA, Lausanne, Schweiz											
Inhaberaktien	CHF	3.50	632 685	9.550				CHF			0.000
25.7.2017 réduction (sans rémunération) de la valeur nominale de CHF 40.00 à CHF 3.50					25.07.	25.07.		CHF			0.000

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponibile CHF
ABB Ltd, Zürich, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.120	1 222 171	26.120	19.04.	21.04.		CHF			0.760
AC Immune SA, Ecublens, Schweiz											
nominatives	CHF	0.020	32 902 310	12.220				CHF			0.000
Accu Holding AG, Emmen, Schweiz											
Namenaktien	CHF	10.00	136 633	n.v.				CHF			0.000
28.4.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben											
acrevis Bank AG, St. Gallen, Schweiz											
Namenaktien	CHF	85.00	13 618 257	1320.000	03.04.	05.04.		CHF			32.000
ACRON HELVETIA I Immobilien AG, Solothurn, Schweiz											
Namenaktien	CHF	5.60	10 201 284	6.790				CHF			0.000
29.8.2017 Nennwertreduktion (mit Entgelt) von bisher CHF 6.20 auf neu CHF 5.60					29.08.	31.08.		CHF			0.000
ACRON HELVETIA III Immobilien AG, Münchenbuchsee, Schweiz											
Namenaktien	CHF	50.06	2 521 745	113.100				CHF			0.000
27.9.2017 Nennwertreduktion (mit Entgelt) von bisher CHF 55.31 auf neu CHF 50.06					27.09.	29.09.		CHF			0.000
Actelion Ltd., Allschwil, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.500	1 053 247	n.v.							
3.3.2017 öffentliches Kaufangebot der Janssen Holding GmbH, Zug, zum Preis von USD 280.00 netto pro Aktie					03.03.	05.05.		CHF			0.000
14.6.2017 Abspaltung: 1 Akt. = 1 Akt. Idorsia AG von CHF 0.05 nom. (VN 36346343)					14.06.	16.06.		CHF		0.050	
9.4.2015/10.2.2017 Rückkauf eigener Aktien (Y)											
7.11.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben											
Addex Therapeutics Ltd, Plan-les-Ouates, Schweiz											
nominatives	CHF	1.00	2 985 075	2.290				CHF			0.000
Adecco Group AG, Zürich, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.100	1 213 860	74.550	28.04.	03.05.		CHF			1.500
20.7.2017 Nennwertreduktion (mit Entgelt) von bisher CHF 1.00 auf neu CHF 0.10					20.07.	24.07.		CHF			0.000
adval tech Holding AG, Niederwangen, Schweiz											
Namenaktien	CHF	20.00	896 792	239.000	22.05.	24.05.		CHF		41.000	
AEVIS VICTORIA SA, Fribourg, Schweiz											
nominatives	CHF	5.00	1 248 819	58.100	15.06.	03.07.		CHF		0.550	
AIRESIS SA, Montreux, Schweiz											
nominatives	CHF	0.250	1 094 762	1.140				CHF			0.000
Airopack Technology Group AG, Baar, Schweiz											
Namenaktien	CHF	5.00	24 260 694	9.750				CHF			0.000
Allreal Holding AG, Baar, Schweiz											
Namenaktien	CHF	50.00	883 756	164.800	25.04.	27.04.		CHF		5.750	
Alpine Select AG, Zug, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.020	1 919 955	16.300	09.02.	13.02.		CHF		3.000	
Alpiq Holding AG, Lausanne, Schweiz											
Namenaktien	CHF	10.00	3 438 970	63.050				CHF			0.000

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
ALSO Holding AG, Emmen, Schweiz												
Namenaktien	CHF	1.00	2 459 027	134.000	23.03.	27.03.		CHF		2.250		
APG SGA SA, Genève, Schweiz												
nominatives	CHF	2.60	1 910 702	455.250	26.05.	30.05.		CHF			12.000	
					26.05.	30.05.		CHF			12.000	(B)
Arbonia AG, Arbon, Schweiz												
Namenaktien	CHF	4.20	11 024 060	16.250				CHF			0.000	
Arundel AG, Zürich, Schweiz												
Namenaktien	CHF	9.00	227 101	6.670				CHF				(I)
ARYZTA AG, Zürich, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.020	4 323 836	38.650	30.01.	01.02.		CHF		0.5731		
Ascom Holding AG, Baar, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.500	1 133 920	25.200	21.04.	25.04.		CHF			0.800	
Autoneum Holding AG, Winterthur, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.050	12 748 036	280.750	03.04.	05.04.		CHF			6.500	
aventron AG, Münchenstein, Schweiz												
Namenaktien	CHF	1.00	2 377 723	8.900	08.05.	10.05.		CHF		0.210		

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponibile CHF
Bachem Holding AG, Bubendorf, Schweiz											
Namenaktien B	CHF	0.050	1 253 020	154.000	26.04.	28.04.		CHF			2.500
Bâloise Holding AG, Basel, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.100	1 241 051	151.700	03.05.	05.05.		CHF			5.200
16.4.2015/13.4.2017 Rückkauf eigener Aktien (Y)											
Bank Cler AG, Basel, Schweiz											
Inhaberaktien	CHF	20.00	1 811 647	42.550	24.04.	26.04.		CHF			1.800
Bank Linth LLB AG, Uznach, Schweiz											
Namenaktien	CHF	20.00	130 775	508.000	24.04.	26.04.		CHF			8.000
Banque Cantonale de Genève, Genève, Schweiz											
au porteur	CHF	100.00	164 268	-				CHF			0.000
2.2.2017 Echange: 1 action au porteur de CHF 100.00 nom. = 2 actions nominatives de CHF 50.00 nom. chacune (VN 35049471)					02.02.	06.02.		CHF			0.000
nominatives	CHF	50.00	35 049 471	163.900	27.04.	02.05.	1	CHF			2.750
Banque Cantonale du Jura SA, Porrentruy, Schweiz											
au porteur	CHF	14.00	3 299 134	-	02.05.	04.05.	11	CHF			1.800
5.5.2017 Echange: 1 action au porteur de CHF 14.00 nom. = 1 action nominative de CHF 14.00 nom. (VN 35066567)					05.05.	05.05.		CHF			0.000
nominatives	CHF	14.00	35 066 567	58.000				CHF			0.000
Banque Cantonale du Valais, Sion, Schweiz											
Namenaktien	CHF	10.00	30 595 120	96.200	28.04.	03.05.		CHF		3.000	
Banque Cantonale Vaudoise, Lausanne, Schweiz											
nominatives	CHF	10.00	1 525 171	735.000	02.05.	04.05.		CHF			23.000
					02.05.	04.05.		CHF		10.000	
Banque Profil de Gestion SA, Genève, Schweiz											
au porteur	CHF	1.00	249 229	4.080				CHF			0.000
Barry Callebaut AG, Zürich, Schweiz											
Namenaktien	CHF	7.29	900 296	2033.000							
28.2.2017 Nennwertreduktion (mit Entgelt) von bisher CHF 18.60 auf neu CHF 7.29					28.02.	02.03.		CHF			0.000
					28.02.	02.03.		CHF		4.190	
Basellandschaftliche Kantonalbank, Liestal, Schweiz											
Kantonalbank-Inhaberzertifikate	CHF	100.00	147 355	904.500	01.03.	03.03.	2016	CHF			35.000
Basilea Pharmaceutica AG, Basel, Schweiz											
Namenaktien	CHF	1.00	1 143 244	75.900				CHF			0.000
Basler Kantonalbank, Basel, Schweiz											
Partizipationsscheine	CHF	8.50	923 646	72.150	28.04.	03.05.		CHF			3.100
16.5.2017 B.V.: 10 alte Partizipationsscheine = 1 neuer (Em.preis CHF 68.00 netto) Anr.: Kein Handel					16.05.	18.05.		CHF			0.000
BB Biotech AG, Schaffhausen, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.200	3 838 999	64.550	20.03.	22.03.		CHF			2.750
12.4.2016/11.4.2019 Rückkauf eigener Aktien (Y)											
BELIMO Holding AG, Hinwil, Schweiz											
Namenaktien	CHF	1.00	150 319	4266.000	05.04.	07.04.		CHF			75.000

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Bell Food Group AG, Basel, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.500	31 596 632	429.500	13.04.	19.04.		CHF			7.000
Bellevue Group AG, Küsnacht, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.100	2 842 210	24.300	23.03.	27.03.		CHF		1.000	
Bergbahnen Engelberg-Trübsee-Titlis AG BET, Wolfenschiessen, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.200	21 470 635	393.250	11.04.	18.04.		CHF			8.000
Berner Kantonalbank AG, Bern, Schweiz											
Namenaktien	CHF	20.00	969 160	176.400	18.05.	22.05.		CHF			6.200
bfw Liegenschaften AG, Frauenfeld, Schweiz											
Namenaktien	CHF	7.50	1 820 611	43.200	28.04.	03.05.		CHF		1.350	
Biella-Neher Holding AG, Brügg, Schweiz											
Namenaktien	CHF	400.00	151 948	4550.000	27.04.	02.05.		CHF			170.00
BKW AG, Bern, Schweiz											
Namenaktien	CHF	2.50	13 029 366	57.950	16.05.	18.05.		CHF			1.600
BLS AG, Bern, Schweiz											
Namenaktien	CHF	1.00	2 588 916	0.550				CHF			0.000
Bobst Group SA, Mex, Schweiz											
Namenaktien	CHF	1.00	1 268 465	129.600	10.04.	12.04.		CHF			1.700
Bossard Holding AG, Zug, Schweiz											
Namenaktien	CHF	5.00	23 862 714	230.000	12.04.	18.04.		CHF			3.300
Bucher Industries AG, Niederweningen, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.200	243 217	396.000	21.04.	25.04.		CHF			5.000
Burckhardt Compression Holding AG, Winterthur, Schweiz											
Namenaktien	CHF	2.50	2 553 602	316.000	04.07.	06.07.		CHF			7.000
Burkhalter Holding AG, Zürich, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.040	21 225 580	126.900	24.05.	29.05.		CHF			5.500
BV Holding AG, Muri bei Bern, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.750	1 339 601	8.300				CHF			0.000
BVZ Holding AG, Zermatt, Schweiz											
Namenaktien	CHF	100.00	820 735	672.500	19.04.	21.04.		CHF		12.000	

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponibile CHF	
Calida Holding AG, Oberkirch, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.100	12 663 946	38.000		16.05.		CHF				(IK)
Castle Alternative Invest AG, Freienbach, Schweiz												
Namenaktien	CHF	5.00	509 275	15.650				CHF			0.000	
6.6.2016/30.6.2017 Rückkauf eigener Aktien (Y)												
3.7/19.7.2017 B.V.: 1 Akt. = 1 Put-Option (bei der Rückgabe der Aktien an die Gesellschaft unterliegt die Differenz zwischen Rückgabepreis (CHF 17.70) und Nominalwert der Aktie (CHF 5.00) der Verrechnungssteuer; die Differenz stellt ein steuerbares Einkommen dar)												
24.7.2017/23.7.2020 Rückkauf eigener Aktien (Y)												
Castle Private Equity AG, Freienbach, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.050	4 885 474	17.900				CHF			0.000	
26.9.2017 Nennwertreduktion (ohne Entgelt; Bildung von Reserven aus Kapitaleinlagen) von bisher CHF 5.00 auf neu CHF 0.05					26.09.	26.09.		CHF			0.000	
5.7.2016/31.5.2017 Rückkauf eigener Aktien (Y)												
1.6/19.6.2017 B.V.: 1 Akt. = 1 Put-Option (bei einer Rückgabe der Aktien an die Gesellschaft, die Differenz zwischen Rückgabepreis (CHF 18.15) und Nominalwert der Aktie (CHF 5.00) unterliegt der Verrechnungssteuer; die Differenz stellt ein steuerbares Einkommen dar)												
26.6.2017/25.6.2020 Rückkauf eigener Aktien (Y)												
Cembra Money Bank AG, Zürich, Schweiz												
Namenaktien	CHF	1.00	22 517 316	90.850	28.04.	03.05.		CHF			1.000	(B)
					28.04.	03.05.		CHF		3.450		
Cham Paper Group Holding AG, Cham, Schweiz												
Namenaktien	CHF	65.00	193 185	452.000	05.05.	09.05.		CHF		4.000		
Ci Com SA, Genève, Schweiz												
au porteur	CHF	20.00	162 581	4.650				CHF			0.000	
Cicor Technologies Ltd., Boudry, Schweiz												
nominatives	CHF	10.00	870 219	60.500				CHF			0.000	
Clariant AG, Muttenz, Schweiz												
Namenaktien	CHF	3.70	1 214 263	27.250	23.03.	27.03.		CHF		0.450		
COLTENE HOLDING AG, Altstätten, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.100	2 534 325	94.900	31.03.	04.04.		CHF			2.700	
Comet Holding AG, Wünnewil-Flamatt, Schweiz												
Namenaktien	CHF	10.00	382 575	-	24.04.	26.04.		CHF		12.000		
26.4.2017 Aufteilung: 1 Akt. von CHF 10.00 nom. = 10 Akt. von je CHF 1.00 nom. (VN 36082699)					26.04.	26.04.		CHF			0.000	
Namenaktien	CHF	1.00	36 082 699	153.400				CHF			0.000	
Compagnie Financière Richemont SA, Bellevue, Schweiz												
Namenaktien	CHF	1.00	21 048 333	88.300	20.09.	22.09.		CHF			1.800	
16.5.2014/15.5.2017 rachat de propres actions												

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	 zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Compagnie Financière Tradition SA, Lausanne, Schweiz											
au porteur	CHF	2.50	1 434 511	95.350	22.05.	30.05.	19	CHF			4.500
22.5.2017 B.V.: 25 alte Akt. = 1 neue (gratis)					22.05.	30.05.		CHF			4.020
Conzzeta AG, Zürich, Schweiz											
Namenaktien	CHF	2.00	24 401 750	1016.000	27.04.	02.05.		CHF			11.000
CPH Chemie + Papier Holding AG, Perlen, Schweiz											
Namenaktien	CHF	5.00	162 471	53.550	23.03.	27.03.		CHF		0.650	
Crealogix Holding AG, Zürich, Schweiz											
Namenaktien	CHF	8.00	1 111 570	154.000	08.11.	10.11.		CHF		0.500	
Credit Suisse Group AG, Zürich, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.040	1 213 853	17.400							
23.5.2017 B.V.: 11 alte N'Akt. = 2 neue (Em.preis CHF 10.80 netto) Anr.: CHF 0.42 / 0.55					23.05.	23.05.		CHF			0.000
9.5.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					09.05.	24.05.		CHF		0.700	

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Datacolor AG, Luzern, Schweiz												
Namenaktien	CHF	1.00	853 104	833.000	11.12.	13.12.		CHF			15.000	
Dätwyler Holding AG, Altdorf, Schweiz												
Inhaberaktien	CHF	0.050	3 048 677	188.400	09.03.	13.03.	11	CHF			2.200	
DKSH Holding AG, Zürich, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.100	12 667 353	85.250	27.03.	29.03.		CHF			3.000	(B)
					27.03.	29.03.		CHF			1.500	
dormakaba Holding AG, Rümlang, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.100	1 179 595	907.500		23.10.		CHF				(IK)
DOTTIKON ES HOLDING AG, Dottikon, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.100	2 073 900	808.000				CHF			0.000	
Dufry AG, Basel, Schweiz												
Namenaktien	CHF	5.00	2 340 545	144.900				CHF			0.000	

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Edisun Power Europe AG, Zürich, Schweiz												
Namenaktien	CHF	30.00	2 473 640	41.500				CHF			0.000	
12.5.2017 Nennwertreduktion (ohne Entgelt; Bildung von Reserven aus Kapitaleinlagen) von bisher CHF 52.55 auf neu CHF 30.00					12.05.	12.05.		CHF			0.000	
29.8.2017 B.V.: 2 alte N'Akt. = 1 neue (Em.preis CHF 30.00 netto) Anr.: Kein Handel					29.08.	31.08.		CHF			0.000	
Edmond de Rothschild (Suisse) S.A., Genève, Schweiz												
au porteur	CHF	500.00	134 749	18500.000	04.05.	08.05.	30	CHF			750.00	
EEII AG, Zug, Schweiz												
Inhaberaktien	CHF	7.10	716 295	2.800				CHF			0.000	
EFG International AG, Zürich, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.500	2 226 822	10.300	03.05.	05.05.		CHF		0.250		
Elma Electronic AG, Wetzikon, Schweiz												
Namenaktien	CHF	11.00	531 916	415.000				CHF			0.000	
Emmi AG, Luzern, Schweiz												
Namenaktien	CHF	10.00	1 282 989	701.500	24.04.	26.04.		CHF		5.900		
EMS-CHEMIE HOLDING AG, Domat/Ems, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.010	1 644 035	650.500	15.08.	17.08.		CHF			13.000	
					15.08.	17.08.		CHF			4.000	(B)
Energiedienst Holding AG, Laufenburg, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.100	3 965 118	25.950	04.04.	06.04.		CHF			1.000	
ENR Russia Invest SA, Genève, Schweiz												
au porteur	CHF	12.40	3 447 695	15.800				CHF			0.000	
Evolva Holding AG, Reinach, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.200	2 121 806	0.300				CHF			0.000	
31.10.2017 B.V.: 8 alte N'Akt. = 5 neue (Em.preis CHF 0.22 netto) Anr.: CHF 0.05 / 0.08					31.10.	02.11.		CHF			0.000	

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Feintool International Holding AG, Lyss, Schweiz											
Namenaktien	CHF	10.00	932 009	118.000	27.04.	02.05.		CHF		2.000	
Flughafen Zürich AG, Kloten, Schweiz											
Namenaktien	CHF	10.00	31 941 693	222.900	24.04.	26.04.		CHF			3.200
					24.04.	26.04.		CHF		3.200	
Forbo Holding AG, Baar, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.100	354 151	1505.000	10.04.	12.04.		CHF		8.300	
					10.04.	12.04.		CHF			10.700
20.10.2015/31.3.2018 Rückkauf eigener Aktien (Y) 16.11/29.11.2017 Rückkauf eigener Aktien (Y): 1 Akt. = CHF 1'430.00 in bar pro zurückgekaufte Aktie											
Fundamenta Real Estate AG, Zug, Schweiz											
Namenaktien	CHF	6.00	4 582 551	14.750	19.04.	21.04.		CHF		0.400	
26.10.2017 B.V.: 3 alte N'Akt. = 1 neue (Em.preis CHF 14.50 netto) Anr.: Kein Handel					26.10.	30.10.		CHF			0.000

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Galenica AG, Bern, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.100	36 067 446	50.050				CHF				(I)
GAM Holding AG, Zürich, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.050	10 265 962	15.750	02.05.	04.05.		CHF		0.650		
28.4.2014/27.4.2017 Rückkauf eigener Aktien (Y)												
gategroup Holding AG, Kloten, Schweiz												
Namenaktien	CHF	5.00	10 018 595	-				CHF			0.000	
27.4.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben												
Gavazzi Holding AG (Carlo), Steinhausen, Schweiz												
Inhaberaktien B	CHF	15.00	1 100 359	339.500	27.07.	02.08.	16	CHF			15.000	
Geberit AG, Rapperswil-Jona, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.100	3 017 040	429.100	07.04.	11.04.		CHF			10.000	
6.6.2017/5.6.2020 Rückkauf eigener Aktien (Y)												
Georg Fischer AG, Schaffhausen, Schweiz												
Namenaktien	CHF	1.00	175 230	1288.000	21.04.	25.04.		CHF			20.000	
Givaudan SA, Vernier, Schweiz												
nominatives	CHF	10.00	1 064 593	2252.000	27.03.	29.03.		CHF			56.000	
Glarner Kantonalbank, Glarus, Schweiz												
Namenaktien	CHF	10.00	18 939 665	30.800	03.05.	05.05.		CHF			0.800	
Goldbach Group AG, Küsnacht, Schweiz												
Namenaktien	CHF	1.25	487 094	35.600	10.04.	12.04.		CHF		1.200		
Graubündner Kantonalbank, Chur, Schweiz												
Partizipationsscheine	CHF	100.00	134 020	1400.000	10.03.	14.03.		CHF			38.000	
Groupe Baumgartner Holding SA, Crissier, Schweiz												
nominatives	CHF	70.00	217 577	333.000				CHF			0.000	
Groupe Minoteries SA, Valbroye, Schweiz												
nominatives	CHF	5.00	1 294 946	365.250	12.06.	14.06.		CHF			7.000	
Gurit Holding AG, Wattwil, Schweiz												
Inhaberaktien	CHF	50.00	801 223	1053.000	18.04.	20.04.		CHF		20.000		

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
HBM Healthcare Investments AG, Zug, Schweiz												
Namenaktien	CHF	58.50	1 262 725	133.300	28.06.	30.06.		CHF		5.800		
6.10.2016/23.6.2019 Rückkauf eigener Aktien (Y)												
Helvetia Holding AG, St.Gallen, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.100	1 227 168	548.500	03.05.	05.05.		CHF			21.000	
HIAG Immobilien Holding AG, Basel, Schweiz												
Namenaktien	CHF	1.00	23 951 877	120.900		28.04.		CHF				(IK)
Highlight Communications AG, Pratteln, Schweiz												
Inhaberaktien	CHF	1.00	653 919	5.830		11.12.		CHF				(IK)
Highlight Event and Entertainment AG, Pratteln, Schweiz												
Inhaberaktien	CHF	9.00	358 325	18.380				CHF			0.000	
26.5.2017 B.V.: 1 alte l'Akt. = 3 neue (Em.preis CHF 15.00 netto) Anr.: Kein Handel					26.05.	26.05.		CHF			0.000	
Hochdorf Holding AG, Hochdorf, Schweiz												
Namenaktien	CHF	10.00	2 466 652	286.250								
14.3.2017 B.V.: 82 alte Akt. = 1 Pflichtwandelanleihe Hochdorf Holding AG (Em.preis CHF 5'000.00) Anr.: Kein Handel					14.03.	14.03.		CHF			0.000	
					09.05.	11.05.		CHF		3.800		
Huber & Suhner AG, Herisau, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.250	3 038 073	50.850	07.04.	11.04.		CHF			1.250	
Hügli Holding AG, Steinach, Schweiz												
Inhaberaktien	CHF	1.00	464 795	804.000	19.05.	23.05.	22	CHF			16.000	
Hypothekarbank Lenzburg AG, Lenzburg, Schweiz												
Namenaktien	CHF	300.00	134 160	4440.000	21.03.	23.03.		CHF			110.00	

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Idorsia AG, Allschwil, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.050	36 346 343	25.450				CHF			0.000
ImmoMentum AG, Aadorf, Schweiz											
Namenaktien	CHF	870.00	1 924 492	2720.000				CHF			0.000
29.8.2017 Nennwertreduktion (mit Entgelt) von bisher CHF 960.00 auf neu CHF 870.00					29.08.	31.08.		CHF			0.000
Implenia AG, Dietlikon, Schweiz											
Namenaktien	CHF	1.02	2 386 855	65.900	27.03.	29.03.		CHF			2.000
INFICON Holding AG, Bad Ragaz, Schweiz											
Namenaktien	CHF	5.00	1 102 994	608.500	18.04.	20.04.		CHF		16.000	
INTERROLL HOLDING SA, S.Antonino/TI, Schweiz											
Namenaktien	CHF	1.00	637 289	1443.000	16.05.	18.05.		CHF			16.000
Intershop Holding AG, Zürich, Schweiz											
Namenaktien	CHF	10.00	27 377 479	487.000	03.04.	05.04.		CHF			20.000
Investis Holding AG, Zürich, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.100	32 509 429	62.650	02.05.	04.05.		CHF		2.350	
IVF HARTMANN Holding AG, Neuhausen am Rheinfall, Schweiz											
Namenaktien	CHF	1.75	18 762 425	181.000	27.04.	02.05.		CHF			2.400

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Julius Bär Gruppe AG, Zürich, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.020	10 248 496	59.600	18.04.	20.04.		CHF		1.200	
Jungfraubahn Holding AG, Interlaken, Schweiz											
Namenaktien	CHF	1.50	1 787 578	127.200	24.05.	29.05.		CHF			2.100

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Kardex AG, Zürich, Schweiz											
Namenaktien	CHF	4.05	10 083 728	119.600				CHF			0.000
5.7.2017 Nennwertreduktion (mit Entgelt) von bisher CHF 7.35 auf neu CHF 4.05					05.07.	07.07.		CHF			0.000
Komax Holding AG, Dierikon, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.100	1 070 215	319.500	16.05.	18.05.		CHF			5.000
					16.05.	18.05.		CHF		1.500	
Kudelski SA, Cheseaux-sur-Lausanne, Schweiz											
au porteur	CHF	8.00	1 226 836	12.050	24.03.	29.03.	17	CHF			0.100
					24.03.	29.03.	17	CHF		0.250	
Kühne + Nagel International AG, Schindellegi, Schweiz											
Namenaktien	CHF	1.00	2 523 886	172.500	11.05.	15.05.		CHF			5.500
Kuros Biosciences AG, Schlieren, Schweiz											
Namenaktien	CHF	1.00	32 581 411	11.900				CHF			0.000
21.6.2017 B.V.: 4 alte N'Akt. = 1 neue (Em.preis CHF 12.50 netto)					21.06.	23.06.		CHF			0.000

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
LafargeHolcim Ltd, Rapperswil-Jona, Schweiz											
Namenaktien	CHF	2.00	1 221 405	54.950		10.05.		CHF			(IK)
1.6.2017/31.12.2018 Rückkauf eigener Aktien (Y)											
Lalique Group SA, Zürich, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.200	3 381 329	38.550	26.06.	28.06.		CHF			0.500
Landis+Gyr Group AG, Zug, Schweiz											
Namenaktien	CHF	10.00	37 115 349	77.600				CHF			0.000
LECLANCHE SA, Yverdon-les-Bains, Schweiz											
nominatives	CHF	1.50	11 030 311	2.630				CHF			0.000
Lem Holding SA, Fribourg, Schweiz											
nominatives	CHF	0.500	2 242 762	1652.000	04.07.	06.07.		CHF			35.000
Leonteq AG, Zürich, Schweiz											
Namenaktien	CHF	1.00	19 089 118	63.000				CHF			0.000
LifeWatch AG, Zug, Schweiz											
Namenaktien	CHF	1.30	1 281 545	-				CHF			0.000
10.5.2017 Kauf-/Umtauschofferte: 1 Akt. LifeWatch AG von CHF 1.30 nom. = USD 10.00 in bar und 0.1617 Akt. BioTelemetry, Inc. von USD 0.001 nom. oder USD 8.00 in bar und Akt. 0.2350 BioTelemetry, Inc. von USD 0.001 nom. (VN 22042825)					10.05.	10.05.		CHF			0.000
29.12.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben											
Lindt & Sprüngli AG (Chocoladefabriken), Kilchberg, Schweiz											
Namenaktien	CHF	100.00	1 057 075	70485.000	24.04.	26.04.	22	CHF			580.00
					24.04.	26.04.	21	CHF		300.00	
Partizipationsscheine	CHF	10.00	1 057 076	5950.000	24.04.	26.04.	22	CHF			58.000
					24.04.	26.04.	21	CHF		30.000	
Logitech International S.A., Apples, Schweiz											
nominatives	CHF	0.250	2 575 132	32.900	25.09.	27.09.		CHF			0.60846
25.4.2014/24.4.2017 rachat de propres actions											
Lonza Group AG, Basel, Schweiz											
Namenaktien	CHF	1.00	1 384 101	263.300							
2.5.2017 B.V.: 7 alte N'Akt. = 2 neue (Em.preis CHF 136.00 netto) Anr.: CHF 13.00 / 16.25					02.05.	02.05.		CHF			0.000
					27.04.	03.05.		CHF		2.750	
Looser Holding AG, Arbon, Schweiz											
Namenaktien	CHF	8.43	2 620 586	-				CHF			0.000
23.6.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben											
Luzerner Kantonalbank AG, Luzern, Schweiz											
Namenaktien	CHF	31.00	1 169 360	465.250	18.04.	20.04.		CHF			11.500

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Matador Private Equity AG, Sarnen, Schweiz											
Inhaberaktien	CHF	10.00	3 077 310	11.110				CHF			0.000
MCH Group AG, Basel, Schweiz											
Namenaktien	CHF	10.00	3 954 285	66.300	28.04.	03.05.		CHF			0.500
Metall Zug AG, Zug, Schweiz											
Namenaktien	CHF	25.00	3 982 108	3696.000	09.05.	11.05.		CHF			70.000
Meyer Burger Technology AG, Thun, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.050	10 850 379	1.670				CHF			0.000
Mikron Holding AG, Biel, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.100	339 006	7.300	27.04.	02.05.		CHF		0.050	
Mobilezone Holding AG, Regensdorf, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.010	27 683 769	12.850	11.04.	13.04.		CHF			0.600
Mobimo Holding AG, Luzern, Schweiz											
Namenaktien	CHF	29.00	1 110 887	261.500	31.03.	04.04.		CHF		10.000	
Molecular Partners AG, Schlieren, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.100	25 637 909	26.300				CHF			0.000
Myriad Group AG, Zürich, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.100	1 962 480	0.700				CHF			0.000
28.8.2017 B.V.: 3 alte N'Akt. = 1 neue (Em.preis CHF 0.50 netto) Anr.: Kein Handel					28.08.	06.09.		CHF			0.000

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
nebag ag, Zürich, Schweiz											
Namenaktien	CHF	3.30	505 943	10.900				CHF			0.000
26.7.2017 Nennwertreduktion (mit Entgelt) von bisher CHF 4.00 auf neu CHF 3.30					26.07.	28.07.		CHF			0.000
Nestlé SA, Cham et Vevey, Schweiz											
nominatives	CHF	0.100	3 886 335	83.800	10.04.	12.04.		CHF			2.300
4.7.2017/3.7.2020 rachat de propres actions (Y)											
New Value AG, Baar, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.100	1 081 986	1.600				CHF			0.000
New Venturetec AG, Zug, Schweiz											
Inhaberaktien	CHF	6.00	703 683	2.680				CHF			0.000
NORINVEST HOLDING SA, Genève, Schweiz											
nominatives	CHF	1.00	1 359 224	n.v.				CHF			0.000
8.5.2017 offre d'achat de Taunus Capital Management AG, Frankfurt am Main, au prix de EUR 1.28 par action						08.05.		CHF			0.000
28.4.2017 cotation supprimée à SIX SX											
Novartis AG, Basel, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.500	1 200 526	82.400	02.03.	06.03.		CHF			2.750
26.2.2014/26.2.2017 Rückkauf eigener Aktien (Y)											
27.2.2017/26.2.2020 Rückkauf eigener Aktien (Y)											
Novavest Real Estate AG, Zürich, Schweiz											
Namenaktien	CHF	33.25	21 218 624	39.000				CHF			0.000
15.5.2017 B.V.: 4 alte N'Akt. = 1 neue (Em.preis CHF 37.00 netto) Anr.: Kein Handel					15.05.	15.05.		CHF			0.000
7.6.2017 Nennwertreduktion (mit Entgelt) von bisher CHF 34.30 auf neu CHF 33.25					07.06.	08.06.		CHF			0.000
16.10.2017 B.V.: 23 alte N'Akt. = 3 neue (Em.preis CHF 38.00 netto) Anr.: Kein Handel					16.10.	16.10.		CHF			0.000

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
OC Oerlikon Corporation AG, Freienbach, Schweiz											
Namenaktien	CHF	1.00	81 682	16.450	13.04.	19.04.		CHF		0.300	
Orascom Development Holding AG, Altdorf, Schweiz											
Namenaktien	CHF	23.20	3 828 567	11.000				CHF			0.000
Orell Füssli Holding AG, Zürich, Schweiz											
Namenaktien	CHF	1.00	342 080	112.800	16.05.	18.05.		CHF			4.000
Oriflame Holding AG, Schaffhausen, Schweiz											
Namenaktien	CHF	1.50	25 642 479	40.260	14.02.	21.02.		EUR		0.21275	
					12.05.	22.05.		EUR		0.82061	
					14.08.	22.08.		EUR		0.28467	
					14.11.	22.11.		EUR		0.28975	
Orior AG, Zürich, Schweiz											
Namenaktien	CHF	4.00	11 167 736	77.150	30.03.	03.04.		CHF			2.090

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Panalpina Welttransport (Holding) AG, Basel, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.100	216 808	151.100	05.05.	09.05.		CHF			3.750	
Pargesa Holding SA, Genève, Schweiz												
au porteur	CHF	20.00	2 178 339	84.500	08.05.	10.05.		CHF			2.440	
Partners Group Holding AG, Baar, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.010	2 460 882	668.000	15.05.	17.05.		CHF			15.000	
Pax Anlage AG, Basel, Schweiz												
Namenaktien	CHF	100.00	217 834	n.v.				CHF			0.000	
20.3.2017 Kaufofferte der Basler Leben AG, Basel zum Preis von CHF 1'600.00 pro Aktie					20.03.	30.05.		CHF			0.000	
10.10.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben												
Peach Property Group AG, Zürich, Schweiz												
Namenaktien	CHF	1.00	11 853 036	28.950				CHF			0.000	
Perfect Holding SA, Lausanne, Schweiz												
nominatives	CHF	0.040	911 512	0.030				CHF			0.000	
Perrot Duval Holding SA, Genève, Schweiz												
au porteur	CHF	50.00	25 262 070	72.800				CHF			0.000	
Phoenix Mecano AG, Stein am Rhein, Schweiz												
Inhaberaktien	CHF	1.00	218 781	614.500	23.05.	29.05.	25	CHF			15.000	
PLAZZA AG, Zürich, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.500	28 414 291	228.000	05.05.	09.05.		CHF			3.000	
poenina holding ag, Opfikon, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.100	12 252 764	60.350				CHF				(I)
3.5.2017 Aufteilung: 1 Akt. von CHF 1'000.00 nom. = 10'000 Akt. von je von CHF 0.10 nom.					03.05.	03.05.		CHF			0.000	
Private Equity Holding AG, Zug, Schweiz												
Namenaktien	CHF	6.00	608 992	76.600	14.07.	18.07.		CHF		3.000		
PSP Swiss Property AG, Zug, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.100	1 829 415	92.350	07.04.	11.04.		CHF			3.350	

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data		Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
					ex. (E)	zahlb. pay. pag.						
Q Capital AG, Hünenberg, Schweiz												
Inhaberaktien	CHF	10.00	1 785 508	33.600				CHF			0.000	
QINO AG, Hünenberg, Schweiz												
Inhaberaktien	CHF	10.00	1 384 973	20.000				CHF				(I)

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Rapid Holding AG, Dietikon, Schweiz											
Namenaktien	CHF	10.00	3 033 336	522.000	02.05.	04.05.		CHF			50.000
RELIEF THERAPEUTICS Holding SA, Genève, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.010	10 019 113	0.010				CHF			0.000
Rieter Holding AG, Winterthur, Schweiz											
Namenaktien	CHF	5.00	367 144	237.800	07.04.	11.04.		CHF		5.000	
Roche Holding AG, Basel, Schweiz											
Genussscheine	CHF	0.000	1 203 204	246.500	16.03.	20.03.	16	CHF			8.200
Inhaberaktien	CHF	1.00	1 203 211	246.200	16.03.	20.03.	16	CHF			8.200
Romande Energie Holding SA, Morges, Schweiz											
nominatives	CHF	25.00	2 560 733	1180.000	01.06.	06.06.		CHF			36.000

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponibile CHF	
Sandpiper Digital Payments AG, St. Gallen, Schweiz												
Inhaberaktien	CHF	0.010	3 305 096	0.200				CHF			0.000	
30.6.2017 Nennwertreduktion (ohne Entgelt; Bildung von gesetzlichen Kapitaleinlagen) von bisher CHF 0.10 auf neu CHF 0.01					30.06.	30.06.		CHF			0.000	
						20.12.		CHF				(I)
Santhera Pharmaceuticals Holding AG, Liestal, Schweiz												
Namenaktien	CHF	1.00	2 714 864	35.950				CHF			0.000	
Schaffner Holding AG, Luterbach, Schweiz												
Namenaktien	CHF	32.50	906 209	312.000				CHF			0.000	
Schindler Holding AG, Hergiswil, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.100	2 463 821	220.500	20.03.	22.03.		CHF			3.000	
					20.03.	22.03.		CHF			2.000	(B)
Partizipationsscheine	CHF	0.100	2 463 819	224.300	20.03.	22.03.		CHF			2.000	(B)
					20.03.	22.03.		CHF			3.000	
Schlatter Industries AG, Schlieren, Schweiz												
Namenaktien	CHF	16.00	227 731	47.750				CHF			0.000	
Schmolz + Bickenbach AG, Luzern, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.500	579 566	0.840				CHF			0.000	
Schweiter Technologies AG, Horgen, Schweiz												
Inhaberaktien	CHF	1.00	1 075 492	1264.000	28.04.	03.05.		CHF			40.000	
Schweiz. Nationalbank, Bern und Zürich, Schweiz												
Namenaktien	CHF	250.00	131 926	3889.000	03.05.	05.05.		CHF			15.000	
SFS Group AG, Au, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.100	23 922 930	113.200	28.04.	03.05.		CHF		1.750		
SGS SA, Genève, Schweiz												
nominatives	CHF	1.00	249 745	2541.000	23.03.	27.03.		CHF			70.000	
Siegfried Holding AG, Zofingen, Schweiz												
Namenaktien	CHF	2.00	1 428 449	324.000		26.04.		CHF				(IK)
Sika AG, Baar, Schweiz												
Inhaberaktien	CHF	0.600	58 797	7740.000	13.04.	19.04.		CHF			96.000	
Sonova Holding AG, Stäfa, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.050	1 254 978	152.200	15.06.	19.06.		CHF			2.300	
1.12.2014/30.11.2017 Rückkauf eigener Aktien (Y)												
Spice Private Equity AG, Zug, Schweiz												
Namenaktien	CHF	10.00	915 331	28.160				CHF			0.000	
St. Galler Kantonalbank AG, St. Gallen, Schweiz												
Namenaktien	CHF	70.00	1 148 406	484.000	05.05.	09.05.		CHF			15.000	
Starrag Group Holding AG, Rorschacherberg, Schweiz												
Namenaktien	CHF	8.50	236 106	65.350		05.05.		CHF				(IK)
Straumann Holding AG, Basel, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.100	1 228 007	688.500	11.04.	13.04.		CHF			4.250	
Sulzer AG, Winterthur, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.010	3 838 891	118.200	10.04.	12.04.		CHF			3.500	
Sunrise Communications Group AG, Zürich, Schweiz												
Namenaktien	CHF	1.00	26 729 122	89.000	13.04.	19.04.		CHF		3.330		

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Swatch Group SA (The), Neuchâtel, Schweiz											
au porteur	CHF	2.25	1 225 515	397.400	26.05.	30.05.	42	CHF			6.750
5.2.2016/4.2.2019 rachat de propres actions (Y)											
nominatives	CHF	0.450	1 225 514	74.500	26.05.	30.05.		CHF			1.350
5.2.2016/4.2.2019 rachat de propres actions (Y)											
Swiss Estates AG, Luzern, Schweiz											
Namenaktien	CHF	9.80	2 392 655	6.030				CHF			0.000
Partizipationsscheine	CHF	9.80	1 930 453	4.100				CHF			0.000
Swiss Finance & Property Investment AG, Zürich, Schweiz											
Namenaktien	CHF	12.60	3 281 613	95.000	18.04.	20.04.		CHF		3.600	
23.6.2017 B.V.: 4 alte N'Akt. = 1 neue (Em.preis CHF 93.50 netto) Anr.: CHF 0.70 / 1.10					23.06.	27.06.		CHF			0.000
5.7.2017 Nennwertreduktion (ohne Entgelt; Bildung von Reserven aus Kapitaleinlagen) von bisher CHF 31.25 auf neu CHF 12.60					05.07.	05.07.		CHF			0.000
Swiss Life Holding AG, Zürich, Schweiz											
Namenaktien	CHF	5.10	1 485 278	345.000	27.04.	02.05.		CHF		11.000	
Swiss Prime Site AG, Olten, Schweiz											
Namenaktien	CHF	15.30	803 838	90.000	18.04.	20.04.		CHF		3.700	
Swiss Re AG, Zürich, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.100	12 688 156	91.250	25.04.	27.04.		CHF			4.850
Swisscom AG, Ittigen, Schweiz											
Namenaktien	CHF	1.00	874 251	518.500	05.04.	07.04.		CHF			22.000
Swissquote Group Holding SA, Gland, Schweiz											
nominatives	CHF	0.200	1 067 586	38.150	16.05.	18.05.		CHF			0.130
					16.05.	18.05.		CHF		0.470	
Swmtl Holding AG, Dornach, Schweiz											
Inhaberaktien	CHF	9.00	257 226	n.v.				CHF			0.000
16.3.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben											
Syngenta AG, Basel, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.100	1 103 746	452.000							
11.5.2017 Titelumtausch: 1 Akt. Syngenta AG von CHF 0.10 nom. = 1 Akt. Syngenta AG (2. Linie) von CHF 0.10 nom. (VN 31631288) oder 1 Akt. Syngenta AG (3. Linie) von CHF 0.10 nom. (VN 31631329)					11.05.	11.05.		CHF			0.000
16.10.2015/29.12.2017 Rückkauf eigener Aktien (Y)					12.05.	16.05.		CHF			5.000 (B)
Namenaktien	CHF	0.100	31 612 454	-	12.05.	16.05.		CHF			5.000 (B)
5.5.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben											
Namenaktien	CHF	0.100	31 631 288	-							
11.5.2017 Kaufofferte der CNAC Saturn (NL) B.V., Amsterdam, zum Preis von USD 465.00 pro Aktie						11.05.		CHF			0.000
					12.05.	16.05.		CHF			5.000 (B)
Namenaktien	CHF	0.100	31 631 329	-							
11.5.2017 Kaufofferte der CNAC Saturn (NL) B.V., Amsterdam, zum Preis von CHF 450.17 pro Aktie						11.05.		CHF			0.000
					12.05.	16.05.		CHF			5.000 (B)

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Tamedia AG, Zürich, Schweiz											
Namenaktien	CHF	10.00	1 117 825	138.000	11.04.	13.04.		CHF			4.500
Tecan Group AG, Hombrechtikon, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.100	1 210 019	202.700	13.04.	19.04.	25	CHF			1.750
Temenos Group AG, Genève, Schweiz											
Namenaktien 3.11.2016/29.12.2017 Rückkauf eigener Aktien	CHF	5.00	1 245 391	125.000	15.05.	17.05.		CHF		0.550	
Thurella AG, Egnach, Schweiz											
Namenaktien	CHF	50.00	1 474 512	142.900	28.04.	02.05.		CHF		2.000	
Thurgauer Kantonalbank, Weinfelden, Schweiz											
Partizipationsscheine	CHF	20.00	23 135 110	101.700	12.06.	14.06.		CHF			2.750
Tornos Holding SA, Moutier, Schweiz											
nominatives	CHF	4.50	1 160 768	6.080				CHF			0.000
Transocean Ltd., Steinhausen, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.100	4 826 551	10.380				CHF			0.000

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
u-blox Holding AG, Thalwil, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.900	3 336 167	191.800		03.05.		CHF				(IK)
UBS Group AG, Zürich und Basel, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.100	24 476 758	17.940	08.05.	10.05.		CHF		0.600		

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponibile CHF	
Valartis Group AG, Baar, Schweiz												
Inhaberaktien	CHF	1.00	184 045	-	18.05.	22.05.		CHF			0.200	
23.5.2017 Titelumtausch: 1 l'Akt. von CHF 1.00 nom. = 1 N'Akt. von CHF 1.00 nom. (VN 36742768)					23.05.	26.05.		CHF			0.000	
Namenaktien	CHF	1.00	36 742 768	9.560				CHF			0.000	
Valiant Holding AG, Luzern, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.500	1 478 650	105.400	22.05.	24.05.		CHF			3.800	
Valora Holding AG, Muttenz, Schweiz												
Namenaktien	CHF	1.00	208 897	325.000	03.04.	05.04.		CHF			12.500	
13.11.2017 B.V.: 5 alte N'Akt. = 1 neue (Em.preis CHF 310.00 netto) Anr.: Kein Handel					13.11.	15.11.		CHF			0.000	
Varia US Properties AG, Zug, Schweiz												
Namenaktien	CHF	1.00	30 528 529	39.600	26.05.	30.05.		CHF			0.150	
						30.05.		CHF				(IK)
						14.12.		CHF				(IK)
VAT Group AG, Sennwald, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.100	31 186 490	144.400	19.05.	23.05.		CHF		4.000		
Vaudoise Assurances Holding SA, Lausanne, Schweiz												
nominatives	CHF	25.00	2 154 566	528.500	10.05.	12.05.		CHF			12.000	
Vetropack Holding SA, Saint-Prex, Schweiz												
au porteur	CHF	50.00	622 761	1876.000	15.05.	17.05.	21	CHF			38.500	
Vifor Pharma AG, St. Gallen, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.010	36 474 934	124.900				CHF			0.000	
Namenaktien	CHF	0.100	1 553 646	-	16.05.	18.05.		CHF			20.000	
22.5.2017 Aufteilung: 1 Akt. von CHF 0.10 nom. = 10 Akt. von je CHF 0.01 nom. (VN 36474934)					22.05.	22.05.		CHF			0.000	
Villars Holding S.A., Fribourg, Schweiz												
nominatives	CHF	44.00	260 965	830.000	15.05.	19.05.		CHF			8.000	
Vögele (Charles) Holding AG, Freienbach, Schweiz												
Inhaberaktien	CHF	3.00	693 777	-				CHF			0.000	
21.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben												
Von Roll Holding AG, Breitenbach, Schweiz												
Inhaberaktien	CHF	0.100	324 535	1.400				CHF			0.000	
Vontobel Holding AG, Zürich, Schweiz												
Namenaktien	CHF	1.00	1 233 554	61.500	06.04.	10.04.	17	CHF			1.900	
					06.04.	10.04.	17	CHF			0.100	(B)
VZ Holding AG, Zürich, Schweiz												
Namenaktien	CHF	0.250	2 820 083	330.500	10.04.	12.04.		CHF			4.200	

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Walter Meier AG, Schwerzenbach, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.100	20 806 262	38.900	28.03.	30.03.		CHF			2.000
Warteck Invest AG, Basel, Schweiz											
Namenaktien	CHF	10.00	261 948	1950.000	29.05.	31.05.		CHF		68.000	
WISeKey International Holding AG, Zug, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.050	31 402 927	6.090				CHF			0.000
Wockhardt Bio AG, Zug, Schweiz											
Inhaberaktien	CHF	1.00	19 304 250	0.500				CHF			0.000

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Ypsomed Holding AG, Burgdorf, Schweiz											
Namenaktien	CHF	14.15	1 939 699	160.600	04.07.	06.07.		CHF		1.300	

Aktien (Schweiz) / Actions (Suisse) / Azioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Zehnder Group AG, Gränichen, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.050	27 653 461	39.950	10.04.	12.04.		CHF			0.950
Züblin Immobilien Holding AG, Zürich, Schweiz											
Namenaktien	CHF	22.50	31 230 968	26.700				CHF			0.000
Zug Estates Holding AG, Zug, Schweiz											
Namenaktien	CHF	25.00	14 805 212	1827.000	13.04.	19.04.		CHF		23.000	
Zuger Kantonalbank, Zug, Schweiz											
Inhaberaktien	CHF	500.00	130 890	5265.000	03.05.	05.05.		CHF			175.00
Zur Rose Group AG, Steckborn, Schweiz											
Namenaktien	CHF	5.75	4 261 528	131.000				CHF			0.000
Zurich Insurance Group AG, Zürich, Schweiz											
Namenaktien	CHF	0.100	1 107 539	296.600	31.03. 31.03.	04.04. 04.04.		CHF CHF		 5.700	11.300
Zwahlen & Mayr SA, Aigle, Schweiz											
au porteur	CHF	200.00	266 173	225.000				CHF			0.000

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Aargauische Kantonalbank, Aarau, Schweiz												
	CHF	5'000.00	14.08.2008	14.08.2017	4 400 468		-	100.600	14.08.	3.500	175.00	N
	CHF	5'000.00	15.11.2011	15.11.2018	14 142 821	%	101.550	100.366	15.11.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	08.03.2016	08.03.2022	31 425 098	%	100.600	100.000	08.03.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	18.05.2015	18.05.2022	27 992 971	%	101.250	100.000	18.05.	0.150	7.500	N
	CHF	5'000.00	16.12.2015	16.12.2022	30 496 696	%	100.550	100.000	16.12.	0.050	2.500	N
	CHF	5'000.00	19.06.2014	19.06.2023	24 514 618	%	106.100	100.265	19.06.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	21.02.2017	21.02.2024	35 368 892	%	100.450	100.105		0.110	0.000	N
	CHF	5'000.00	17.10.2016	17.10.2024	33 658 764	%	99.650	100.000	17.10.	0.020	1.000	N
	CHF	5'000.00	01.07.2016	01.07.2025	32 859 923	%	99.600	100.022	01.07.	0.060	3.000	N
	CHF	5'000.00	07.09.2017	07.09.2026	37 935 422	%	100.250	100.133		0.250	0.000	N
	CHF	5'000.00	13.04.2015	13.04.2028	27 552 788	%	103.400	101.350	13.04.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	23.01.2015	23.01.2030	26 208 507	%	105.500	101.097	23.01.	0.875	43.750	N
	CHF	5'000.00	18.05.2012	18.05.2037	18 463 691	%	116.700	100.250	18.05.	1.600	80.000	N
ABB Ltd, Zürich, Schweiz												
	CHF	5'000.00	23.01.2012	23.11.2018	14 669 652	%	101.850	100.734	23.11.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	11.10.2011	11.10.2021	13 926 500	%	108.350	100.700	11.10.	2.250	112.50	N
Adecco Group AG, Zürich, Schweiz												
	CHF	5'000.00	18.07.2012	18.12.2017	18 927 603		-	100.558	18.12.	1.875	93.750	N
	CHF	5'000.00	18.07.2012	18.12.2020	18 927 605	%	108.100	100.780	18.12.	2.625	131.25	N
Aduno Holding AG, Opfikon, Schweiz												
	CHF	5'000.00	06.05.2015	06.04.2017	28 012 865		-	100.000	06.01. 06.04.	VAR.	0.000 0.000	N
	CHF	5'000.00	06.05.2015	05.05.2017	28 014 230		-	100.000	05.05.	0.000	0.000	N
	CHF	1'000.00	27.10.2011	27.10.2017	14 041 011		-	100.506	27.10.	2.250	22.500	N
	CHF	5'000.00	21.02.2017	21.01.2019	35 561 661	%	100.370	100.150	21.04. 21.07. 21.10.	VAR.	0.000 0.000 0.000	N
	CHF	5'000.00	17.07.2014	16.07.2021	24 692 153	%	104.300	100.319	16.07.	1.125	56.250	N
Aeroport International de Geneve, Le Grand-Saconnex, Schweiz												
	CHF	5'000.00	20.09.2017	20.09.2027	37 926 870	%	99.550	100.049		0.400	0.000	N
AEVIS VICTORIA SA, Fribourg, Schweiz												
	CHF	5'000.00	02.07.2013	02.07.2018	21 492 609	%	101.300	100.000	02.07.	3.500	175.00	N
	CHF	5'000.00	04.06.2014	04.06.2019	24 010 959	%	102.100	100.000	04.06.	2.750	137.50	N
	CHF	5'000.00	07.06.2016	07.06.2021	32 542 916	%	103.550	100.000	07.06.	2.500	125.00	N
AKEB AG fuer Kernenergie-Beteiligungen Luzern, Luzern, Schweiz	CHF	5'000.00	19.10.2016	19.10.2022	33 782 927	%	102.050	100.000	19.10.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	09.06.2016	09.06.2023	32 344 011	%	101.200	100.792	09.06.	1.625	81.250	N
Allreal Holding AG, Baar, Schweiz												
	CHF	5'000.00	02.04.2014	02.04.2019	23 427 444	%	101.730	100.486	02.04.	1.250	62.500	N
	CHF	5'000.00	23.09.2013	23.09.2020	22 213 665	%	105.100	100.311	23.09.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	31.03.2015	31.03.2021	27 334 782	%	101.800	100.808	31.03.	0.750	37.500	N
	CHF	5'000.00	12.05.2016	10.05.2024	31 251 272	%	100.950	100.000	10.05.	0.625	31.076	N
	CHF	5'000.00	31.03.2015	31.03.2025	27 334 783	%	106.250	100.910	31.03.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	19.12.2017	19.06.2026	37 347 622	%	100.350	100.298		0.750	0.000	N
	CHF	5'000.00	30.03.2017	30.03.2027	35 767 611	%	101.800	100.550		0.875	0.000	N
Alpiq Holding AG, Lausanne, Schweiz												
	CHF	5'000.00	15.05.2013		21 218 403	%	91.150	100.000	15.11.	5.000	250.00	N
	CHF	5'000.00	10.02.2009	10.02.2017	4 972 768		-	100.830	10.02.	4.000	200.00	N
	CHF	5'000.00	13.04.2012	13.04.2017	14 380 835		-	100.027	13.04.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	01.03.2006	01.03.2018	2 430 282	%	100.320	100.820	01.03.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	30.10.2008	30.10.2018	4 622 991	%	102.580	101.052	30.10.	3.875	193.75	N
	CHF	5'000.00	25.11.2009	25.11.2019	10 316 502	%	103.200	100.700	25.11.	3.000	150.00	N
	CHF	5'000.00	20.09.2011	20.09.2021	13 694 028	%	102.650	100.922	20.09.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	16.05.2012	16.05.2022	18 418 332	%	103.600	100.650	16.05.	3.000	150.00	N
	CHF	5'000.00	30.06.2015	30.06.2023	28 550 933	%	99.000	100.567	30.06.	2.125	106.25	N
AMAG Leasing AG, Baden, Schweiz	CHF	5'000.00	29.07.2014	29.07.2024	24 889 049	%	97.500	100.296	29.07.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	27.10.2017	27.10.2021	38 599 703	%	100.550	100.000		0.350	0.000	N
Andermatt Swiss Alps Ltd, Andermatt, Schweiz	CHF	5'000.00	27.10.2017	25.10.2024	38 599 704	%	100.800	100.021		0.875	0.000	N
	CHF	5'000.00	11.12.2015	11.12.2020	30 595 458	%	100.000	100.000	11.12.	3.875	193.75	N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF		IUP
Appenzeller Bahnen AG, Herisau, Schweiz													
	CHF	5'000.00	15.07.2016	15.07.2031	33 093 919	%	93.100	100.000	15.07.	0.000	0.000		N
ARYZTA AG, Zürich, Schweiz													
	CHF	5'000.00	25.04.2013		20 004 481	%	92.750	101.000	25.04.	4.000	200.00		N
	CHF	5'000.00	28.10.2014		25 359 278	%	86.750	101.000	28.04.	3.500	175.00		N
Autoneum Holding AG, Winterthur, Schweiz													
	CHF	5'000.00	14.12.2012	14.12.2017	19 677 043		-	100.000	14.12.	4.375	218.75		N
	CHF	5'000.00	04.07.2016	04.07.2023	32 621 390	%	101.950	100.168	04.07.	1.125	56.250		N
	CHF	5'000.00	08.12.2017	08.12.2025	37 347 603	%	100.850	100.190		1.125	0.000		N
Axpo Holding AG, Baden, Schweiz													
	CHF	5'000.00	26.02.2010	26.02.2020	10 967 447	%	104.750	100.464	26.02.	2.625	131.25		N
	CHF	5'000.00	29.07.2016	29.05.2024	33 014 314	%	104.000	100.000	29.05.	1.750	72.916		N
	CHF	5'000.00	26.02.2010	26.02.2025	10 967 448	%	111.650	101.568	26.02.	3.125	156.25		N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF		IUP
Bâloise Holding AG, Basel, Schweiz													
	CHF	5'000.00	12.10.2012	12.10.2017	18 829 553		-	100.865	12.10.	1.000	50.000		N
	CHF	5'000.00	01.03.2012	01.03.2019	14 829 501	%	103.000	100.713	01.03.	2.250	112.50		N
	CHF	5'000.00	14.10.2010	14.10.2020	11 768 379	%	108.400	100.581	14.10.	2.875	143.75		N
	CHF	5'000.00	07.07.2011	07.07.2021	13 180 461	%	110.650	101.249	07.07.	3.000	150.00		N
	CHF	5'000.00	12.10.2012	12.10.2022	19 469 508	%	108.650	100.603	12.10.	2.000	100.00		N
	CHF	5'000.00	26.04.2013	26.04.2023	20 004 482	%	108.200	100.812	26.04.	1.750	87.500		N
	CHF	5'000.00	19.12.2014	19.12.2024	26 139 906	%	105.600	100.628	19.12.	1.125	56.250		N
Banca dello Stato del Cantone Ticino, Bellinzona, Schweiz													
	CHF	5'000.00	15.06.2007	15.06.2017	3 121 210		-	100.350	15.06.	3.000	150.00		N
	CHF	5'000.00	15.12.2011	15.12.2021	14 407 538	%	113.300	100.475	15.12.	3.750	187.50		N
	CHF	5'000.00	24.06.2015	24.06.2024	28 372 736	%	102.500	101.082	24.06.	0.500	25.000		N
	CHF	5'000.00	15.06.2017	15.06.2027	36 817 287	%	99.850	100.197		0.300	0.000		N
Bank Cler AG, Basel, Schweiz													
	CHF	5'000.00	28.11.2017	28.11.2025	37 347 604	%	101.450	100.667		0.500	0.000		N
Bank J. Safra Sarasin AG, Basel, Schweiz													
	CHF	5'000.00	28.05.2014	28.05.2020	23 831 569	%	102.700	100.543	28.05.	1.000	50.000		N
Banque Cantonale de Fribourg, Fribourg, Schweiz													
	CHF	5'000.00	17.02.2010	17.02.2017	10 916 929		-	100.090	17.02.	1.875	93.750		N
	CHF	5'000.00	05.02.2014	05.02.2021	23 334 165	%	104.550	100.132	05.02.	1.125	56.250		N
	CHF	5'000.00	14.06.2011	14.06.2021	13 010 412	%	108.950	100.000	14.06.	2.250	112.50		N
	CHF	5'000.00	01.02.2012	01.02.2022	14 684 344	%	105.250	100.331	01.02.	1.125	56.250		N
	CHF	5'000.00	28.03.2013	28.03.2023	20 858 069	%	106.200	100.359	28.03.	1.125	56.250		N
	CHF	5'000.00	03.06.2014	03.06.2024	24 417 520	%	107.650	100.523	03.06.	1.250	62.500		N
	CHF	5'000.00	03.02.2015	03.02.2025	26 580 119	%	103.150	100.292	03.02.	0.550	27.500		N
	CHF	1'000.00	17.02.2017	17.02.2027	34 708 280	%	100.350	100.000		0.300	0.000		N
	CHF	5'000.00	09.04.2015	09.04.2027	27 425 351	%	103.000	100.318	09.04.	0.600	30.000		N
	CHF	5'000.00	07.06.2012	07.06.2027	18 557 783	%	111.050	100.634	07.06.	1.450	72.500		N
	CHF	5'000.00	23.02.2016	23.02.2028	31 064 652	%	101.600	100.671	23.02.	0.500	25.000		N
Banque Cantonale de Genève, Genève, Schweiz													
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG	CHF	5'000.00	04.07.2014		24 569 155	%	101.650	101.000	04.02.	2.875	100.00	(L)	N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG	CHF	5'000.00	28.06.2017		36 701 398	%	101.800	100.000		1.000	0.000		N
	USD	5'000.00	23.06.2015	23.06.2017	28 321 732		-	100.205	23.06.	1.375	33.302		N
	CHF	5'000.00	07.11.2011	07.11.2018	13 072 087	%	102.860	100.496	07.11.	3.125	156.25		N
	CHF	5'000.00	10.06.2015	10.06.2024	28 252 613	%	102.500	100.066	10.06.	0.500	25.000		N
28.6.2017/28.6.2027 ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG	CHF	5'000.00	28.06.2017	28.06.2027	36 869 771	%	99.350	100.024		1.125	0.000		N
Banque Cantonale du Jura SA, Porrentruy, Schweiz													
	CHF	5'000.00	04.03.2015	04.03.2025	27 173 709	%	103.100	100.728	04.03.	0.625	31.250		N
Banque Cantonale du Valais, Sion, Schweiz													
	CHF	5'000.00	19.12.2011	19.12.2018	14 466 889	%	102.900	100.495	19.12.	3.000	150.00		N
	CHF	5'000.00	18.05.2011	18.05.2021	12 905 736	%	108.650	100.148	18.05.	2.375	118.75		N
	CHF	5'000.00	15.09.2015	15.09.2021	29 334 339	%	101.100	100.000	15.09.	0.080	4.000		N
	CHF	5'000.00	15.12.2014	15.12.2021	26 228 623	%	102.200	100.138	15.12.	0.375	18.750		N
	CHF	5'000.00	28.10.2013	28.10.2022	22 457 464	%	107.300	100.229	28.10.	1.500	75.000		N
	CHF	5'000.00	16.03.2015	16.03.2023	27 303 789	%	101.300	100.000	16.03.	0.250	12.500		N
	CHF	5'000.00	15.12.2014	15.12.2023	26 228 625	%	103.450	100.282	15.12.	0.625	31.250		N
	CHF	5'000.00	19.02.2016	19.08.2024	31 142 761	%	100.950	100.084	19.08.	0.200	10.000		N
	CHF	5'000.00	15.09.2015	15.09.2025	29 334 341	%	101.750	100.122	15.09.	0.400	20.000		N
	CHF	5'000.00	02.02.2017	02.02.2026	35 259 585	%	99.950	100.045		0.200	0.000		N
Banque Cantonale Neuchâteloise, Neuchâtel, Schweiz													
	CHF	5'000.00	26.04.2012	26.04.2021	18 336 616	%	104.750	101.089	26.04.	1.250	62.500		N
	CHF	5'000.00	15.09.2017	30.09.2027	36 153 317	%	101.300	101.052		0.500	0.000		N
Banque Cantonale Vaudoise, Lausanne, Schweiz													
	CHF	5'000.00	25.03.2010	25.03.2020	11 081 406	%	106.350	101.380	25.03.	2.500	125.00		N
	CHF	5'000.00	28.03.2014	28.03.2024	23 931 220	%	109.000	100.454	28.03.	1.500	75.000		N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF		IUP
	CHF	5'000.00	28.11.2017	28.11.2025	39 149 151	%	100.650	100.059		0.250	0.000		N
	CHF	5'000.00	30.11.2011	30.11.2026	14 330 200	%	111.950	100.170	30.11.	1.625	81.250		N
	CHF	5'000.00	13.12.2016	13.12.2028	34 095 342	%	100.750	100.320	13.12.	0.500	25.000		N
	CHF	5'000.00	12.07.2017	12.07.2029	37 283 156	%	100.350	100.641		0.500	0.000		N
	CHF	5'000.00	07.04.2016	07.04.2031	31 993 276	%	98.050	100.328	07.04.	0.400	20.000		N
Basel-Landschaft, Liestal, Schweiz													
	CHF	5'000.00	30.09.2014	30.03.2022	25 290 368	%	103.300	101.035	30.03.	0.500	25.000		N
	CHF	5'000.00	24.06.2015	24.06.2024	28 285 786	%	102.200	100.736	24.06.	0.250	12.500		N
	CHF	5'000.00	26.02.2015	26.02.2026	26 785 598	%	100.800	100.328	26.02.	0.125	6.250		N
	CHF	5'000.00	30.09.2014	30.03.2027	25 290 372	%	108.400	101.073	30.03.	1.000	50.000		N
	CHF	5'000.00	26.06.2013	26.06.2028	21 492 587	%	113.650	101.553	26.06.	1.500	75.000		N
	CHF	5'000.00	10.05.2011	10.05.2029	12 883 325	%	126.850	101.350	10.05.	2.625	131.25		N
	CHF	5'000.00	10.05.2011	10.05.2030	12 883 328	%	128.400	101.250	10.05.	2.625	131.25		N
	CHF	5'000.00	24.06.2015	24.06.2032	28 285 787	%	105.300	101.913	24.06.	0.750	37.500		N
	CHF	5'000.00	30.09.2014	29.09.2034	25 290 376	%	114.800	101.429	29.09.	1.375	68.750		N
	CHF	5'000.00	26.02.2015	26.02.2036	26 785 599	%	102.250	100.383	26.02.	0.625	31.250		N
	CHF	5'000.00	05.03.2015	05.03.2040	27 215 417	%	108.900	100.663	05.03.	1.000	50.000		N
	CHF	5'000.00	26.06.2013	26.06.2043	21 492 588	%	127.150	102.059	26.06.	1.750	87.500		N
Basellandschaftliche Kantonalbank, Liestal, Schweiz													
	CHF	5'000.00	14.12.2007	14.12.2017	3 567 872		-	100.220	14.12.	3.000	150.00		N
	CHF	5'000.00	27.02.2012	27.02.2018	14 989 797	%	100.190	100.450	27.02.	0.625	31.250		N
	CHF	5'000.00	25.06.2010	25.06.2019	11 367 840	%	103.300	100.450	25.06.	1.750	87.500		N
	CHF	5'000.00	16.12.2009	16.12.2019	10 768 544	%	105.700	101.430	16.12.	2.500	125.00		N
	CHF	5'000.00	20.04.2016	20.04.2020	31 220 385	%	100.850	100.066	20.04.	0.000	0.000		N
	CHF	5'000.00	09.11.2010	09.11.2020	11 860 790	%	106.050	100.610	09.11.	1.750	87.500		N
	CHF	5'000.00	06.10.2017	06.10.2021	38 158 388	%	100.700	101.207		0.000	0.000		N
	CHF	5'000.00	04.10.2012	04.10.2022	19 411 207	%	105.150	100.661	04.10.	1.000	50.000		N
	CHF	5'000.00	27.03.2013	27.03.2023	20 870 138	%	106.350	100.359	27.03.	1.125	56.250		N
	CHF	5'000.00	22.11.2011	22.11.2024	14 183 340	%	112.500	101.276	22.11.	1.750	87.500		N
	CHF	5'000.00	13.05.2015	13.05.2025	27 972 034	%	100.950	100.123	13.05.	0.250	12.500		N
	CHF	5'000.00	30.03.2015	30.03.2028	27 431 478	%	104.100	101.525	30.03.	0.750	37.500		N
Basler Kantonalbank, Basel, Schweiz													
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG	CHF	200'000.00	01.04.2015		27 576 460	%	102.550	100.000	01.04.	2.000	4'000.00	(L)	N
	CHF	5'000.00	26.10.2010	26.10.2018	11 810 977	%	101.710	100.900	26.10.	1.500	75.000		N
	CHF	5'000.00	24.03.2006	24.03.2021	2 467 494	%	109.000	100.700	24.03.	2.500	125.00		N
	USD	5'000.00	08.02.2017	08.02.2022	35 342 799	%	101.500	100.561		2.750	0.000		N
	CHF	5'000.00	29.06.2007	29.06.2022	3 144 273	%	115.250	101.120	29.06.	3.250	162.50		N
	CHF	5'000.00	10.08.2015	10.08.2023	29 000 713	%	102.150	100.889	10.08.	0.375	18.750		N
	CHF	5'000.00	26.10.2010	26.10.2026	11 809 566	%	113.810	100.640	26.10.	1.875	93.750		N
	CHF	5'000.00	02.03.2012	02.03.2027	14 954 957	%	111.350	100.767	02.03.	1.500	75.000		N
	CHF	1'000.00	22.06.2017	22.06.2027	35 357 431	%	100.350	100.468		0.300	0.000		N
	CHF	5'000.00	15.11.2010	15.11.2032	11 915 366	%	120.250	101.630	15.11.	2.000	100.00		N
Basler Leben AG, Basel, Schweiz													
	CHF	5'000.00	19.09.2017		37 961 099	%	101.500	100.000		1.750	0.000		N
	CHF	5'000.00	19.09.2017	19.06.2048	37 961 100	%	100.700	100.000		2.200	0.000		N
Bauwerk Parkett AG, St. Margrethen, Schweiz													
	CHF	5'000.00	21.05.2013	21.05.2018	20 796 108	%	100.990	100.500	21.05.	4.125	206.25		N
Bell Food Group AG, Basel, Schweiz													
	CHF	5'000.00	16.05.2013	16.05.2018	21 226 729	%	100.560	100.657	16.05.	1.000	50.000		N
	CHF	5'000.00	16.05.2013	16.05.2022	21 226 733	%	107.200	100.629	16.05.	1.750	87.500		N
	CHF	5'000.00	24.03.2016	24.03.2025	31 251 268	%	102.500	100.000	24.03.	0.625	31.250		N
Bern (Kanton), Bern, Schweiz													
	CHF	5'000.00	27.06.2007	27.06.2019	3 182 382	%	105.500	100.308	27.06.	3.125	156.25		N
	CHF	5'000.00	24.04.2009	24.04.2020	10 052 418	%	107.250	100.016	24.04.	2.625	131.25		N
	CHF	5'000.00	20.09.2013	20.09.2021	22 196 173	%	106.050	100.599	20.09.	1.250	62.500		N
	CHF	5'000.00	26.11.2009	26.11.2021	10 701 212	%	111.000	100.106	26.11.	2.500	125.00		N
	CHF	5'000.00	25.03.2010	25.03.2022	11 049 322	%	111.250	101.009	25.03.	2.375	118.75		N
	CHF	5'000.00	31.05.2010	31.05.2023	11 293 348	%	113.300	100.734	31.05.	2.250	112.50		N
	CHF	5'000.00	22.04.2014	22.04.2024	23 971 329	%	108.600	101.101	22.04.	1.250	62.500		N
	CHF	5'000.00	25.10.2012	25.10.2024	19 469 511	%	107.350	100.100	25.10.	1.000	50.000		N
	CHF	5'000.00	24.09.2010	24.09.2025	11 469 540	%	113.550	101.667	24.09.	1.750	87.500		N
	CHF	5'000.00	20.04.2011	20.04.2026	12 697 764	%	118.200	100.409	20.04.	2.250	112.50		N
	CHF	5'000.00	30.03.2012	30.03.2027	14 380 834	%	110.650	100.340	30.03.	1.250	62.500		N
	CHF	5'000.00	07.02.2013	07.02.2028	20 436 565	%	110.750	100.984	07.02.	1.250	62.500		N
	CHF	5'000.00	15.05.2013	15.05.2029	20 527 672	%	114.150	101.724	15.05.	1.500	75.000		N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	CHF	5'000.00	12.09.2014	12.09.2030	25 251 041	%	111.900	101.558	12.09.	1.250	62.500	N
	CHF	5'000.00	18.11.2016	18.11.2031	34 336 679	%	95.850	100.037	20.11.	0.050	2.500	N
	CHF	5'000.00	11.02.2015	11.02.2032	26 630 737	%	104.100	100.338	11.02.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	28.09.2017	28.09.2037	37 961 098	%	99.300	100.000		0.500	0.000	N
Bern (Stadt), Bern, Schweiz												
	CHF	5'000.00	30.01.2009	30.01.2019	4 966 862	%	103.410	100.775	30.01.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	01.11.2011	01.11.2024	13 876 081	%	110.900	100.900	01.11.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	01.04.2010	01.04.2025	10 915 275	%	117.450	100.697	01.04.	2.500	125.00	N
	CHF	5'000.00	26.09.2005	26.09.2025	2 256 617	%	118.400	101.050	26.09.	2.500	125.00	N
	CHF	5'000.00	31.03.2016	31.03.2027	31 941 612	%	98.050	100.000	31.03.	0.040	2.000	N
	CHF	5'000.00	25.02.2013	25.02.2028	20 672 882	%	111.900	100.120	25.02.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	31.03.2016	31.03.2036	31 941 613	%	97.900	100.954	31.03.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	11.10.2013	11.10.2038	22 364 326	%	129.000	100.950	11.10.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	12.06.2017	13.06.2039	36 427 741	%	99.000	101.497		0.625	0.000	N
	CHF	5'000.00	01.04.2011	01.04.2041	12 687 580	%	137.950	100.428	01.04.	2.500	125.00	N
Berner Kantonalbank AG, Bern, Schweiz												
	CHF	5'000.00	14.07.2015	14.07.2025	28 613 887	%	104.650	100.989	14.07.	0.750	37.500	N
BKW AG, Bern, Schweiz												
	CHF	5'000.00	15.10.2010	15.10.2018	11 784 359	%	101.860	100.384	15.10.	1.875	93.750	N
	CHF	5'000.00	29.07.2009	29.07.2019	10 316 457	%	105.600	100.425	29.07.	3.375	168.75	N
	CHF	5'000.00	27.04.2007	27.04.2022	3 035 671	%	112.650	100.525	27.04.	3.000	150.00	N
	CHF	5'000.00	15.10.2010	15.10.2030	11 784 374	%	115.250	100.465	15.10.	2.500	125.00	N
Bobst Group SA, Mex, Schweiz												
	CHF	5'000.00	20.02.2014	20.02.2019	23 297 395	%	101.970	100.500	20.02.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	30.09.2014	30.09.2020	24 989 911	%	102.400	100.500	30.09.	1.500	75.000	N
Bucher Industries AG, Niederweningen, Schweiz												
	CHF	5'000.00	02.10.2014	02.10.2020	25 361 353	%	101.150	100.182	02.10.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	02.10.2014	02.10.2024	25 361 354	%	104.800	101.001	02.10.	1.375	68.750	N
Bühler Holding AG, Uzwil, Schweiz												
	CHF	5'000.00	21.12.2017	21.12.2022	38 960 607	%	100.000	100.237		0.100	0.000	N
	CHF	5'000.00	21.12.2017	21.12.2026	38 960 608	%	100.250	100.746		0.600	0.000	N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF		IUP
Cembra Money Bank AG, Zürich, Schweiz													
	CHF	5'000.00	29.11.2013	29.11.2017	22 797 552		-	100.265	29.11.	1.125	56.250		N
	CHF	5'000.00	14.10.2014	14.10.2019	25 528 701	%	101.800	100.548	14.10.	0.750	37.500		N
	CHF	5'000.00	15.09.2015	15.09.2021	29 505 091	%	101.750	100.000	15.09.	0.500	25.000		N
	CHF	5'000.00	14.10.2014	14.10.2022	25 528 702	%	105.400	100.593	14.10.	1.250	62.500		N
	CHF	5'000.00	05.10.2016	05.10.2023	33 658 773	%	100.050	100.000	05.10.	0.180	9.000		N
	CHF	5'000.00	23.11.2017	23.05.2024	38 599 709	%	100.150	100.129		0.250	0.000		N
	CHF	5'000.00	27.06.2017	27.06.2025	36 720 671	%	100.450	100.632		0.375	0.000		N
Centrale nucleaire de Goesgen-Daeniken SA, Daeniken, Schweiz													
	CHF	5'000.00	30.09.2013	30.09.2020	21 565 071	%	102.700	100.585	30.09.	2.000	100.00		N
Citychamp Watch & Jewellery SwissCo AG, Zuerich, Schweiz													
	CHF	5'000.00	24.07.2014	24.07.2019	24 761 123	%	101.450	100.000	24.07.	3.625	181.25		N
Clariant AG, Muttenz, Schweiz													
	CHF	5'000.00	09.06.2011	09.06.2017	13 016 441		-	100.326	09.06.	3.125	156.25		N
	CHF	5'000.00	26.09.2012	26.09.2018	18 829 523	%	101.760	100.411	26.09.	2.500	125.00		N
	CHF	5'000.00	24.04.2012	24.04.2019	18 172 162	%	103.900	100.736	24.04.	3.250	162.50		N
	CHF	5'000.00	26.09.2012	26.09.2022	18 829 531	%	113.350	100.160	26.09.	3.500	175.00		N
	CHF	5'000.00	17.10.2014	17.10.2024	25 359 275	%	106.600	101.053	17.10.	2.125	106.25		N
Clientis AG, Bern, Schweiz													
	CHF	5'000.00	18.04.2013	18.04.2018	20 960 904	%	100.400	100.209	18.04.	1.000	50.000		N
	CHF	5'000.00	29.06.2015	29.06.2022	28 440 041	%	101.750	100.120	29.06.	0.500	25.000		N
Comet Holding AG, Wünnewil-Flamatt, Schweiz													
	CHF	5'000.00	20.04.2016	20.04.2021	32 061 943	%	102.650	100.000	20.04.	1.875	93.750		N
Compagnie Financière Tradition SA, Lausanne, Schweiz													
	CHF	5'000.00	23.06.2015	23.06.2020	28 385 142	%	102.300	100.000	23.06.	2.000	100.00		N
	CHF	5'000.00	21.11.2016	21.11.2022	34 336 676	%	102.550	100.000	21.11.	1.625	81.250		N
Coop-Gruppe Genossenschaft, Basel, Schweiz													
	CHF	5'000.00	29.09.2010	29.09.2017	11 733 281		-	100.650	29.09.	2.000	100.00		N
	CHF	5'000.00	25.07.2012	25.07.2019	18 872 681	%	102.300	100.351	25.07.	1.250	62.500		N
	CHF	5'000.00	31.07.2015	31.07.2020	28 781 784	%	100.950	100.000	31.07.	0.250	12.500		N
	CHF	5'000.00	16.06.2014	16.06.2021	24 465 352	%	102.950	101.023	16.06.	0.875	43.750		N
	CHF	5'000.00	30.06.2016	30.09.2022	32 637 143	%	100.550	100.132	30.09.	0.250	12.500		N
	CHF	5'000.00	29.09.2014	29.09.2023	25 428 477	%	104.450	100.650	29.09.	1.000	50.000		N
	CHF	5'000.00	31.07.2015	31.07.2024	28 781 785	%	103.600	100.432	31.07.	0.875	43.750		N
	CHF	5'000.00	19.05.2016	19.05.2026	31 941 598	%	100.400	100.512	19.05.	0.500	25.000		N
	CHF	5'000.00	30.06.2016	19.05.2026	32 637 144	%	96.100	100.058	19.05.	0.500	25.000		N
	CHF	5'000.00	29.09.2017	29.09.2027	37 926 871	%	99.800	100.341		0.500	0.000		N
CPH Chemie + Papier Holding AG, Perlen, Schweiz													
	CHF	5'000.00	10.07.2014	10.07.2019	24 761 122	%	102.550	100.000	10.07.	2.750	137.50		N
Credit Suisse AG, Zürich, Schweiz													
	CHF	5'000.00	21.06.2010	21.06.2017	11 398 703		-	100.650	21.06.	2.375	118.75		N
	CHF	5'000.00	11.07.2014	11.07.2019	24 825 945	%	101.600	100.524	11.07.	0.750	37.500		N
	CHF	5'000.00	16.03.2010	16.03.2020	11 044 285	%	107.000	101.078	16.03.	3.375	168.75		N
8.8.2013/8.8.2023 ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG	USD	1'000.00	08.08.2013	08.08.2023	22 034 852	%	112.150	100.000	08.02. 08.08.	6.500	24.587 24.160	(L) (L)	N
8.8.2013/8.8.2023 ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG	USD	1'000.00	08.08.2013	08.08.2023	22 034 850	%	112.150	100.000	08.02. 08.08.	6.500	24.587 24.160	(L) (L)	N
18.9.2013/18.9.2025 ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG	EUR	1'000.00	18.09.2013	18.09.2025	22 349 088	%	113.360	100.000	18.09.	5.750	56.949	(L)	N
Credit Suisse Group AG, Zürich, Schweiz													
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG	CHF	5'000.00	04.09.2013		22 180 379	%	103.050	100.000	04.09.	4.280	214.00	(L)	N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG	USD	1'000.00	11.12.2013		23 059 334	%	114.010	100.000	11.06. 11.12.	7.500	31.352 32.045	(L) (L)	N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF		IUP
11.12.2017 7.5% 2013-Without Fixed Maturity -144A- Fltg Rt	USD	1'000.00	11.12.2013		23 059 119	%	114.490	100.000	11.06. 11.12.	7.500	31.352 32.045		N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG	USD	1'000.00	18.06.2014		24 686 434	%	108.380	100.000	18.06. 18.12.	4.850	23.617 23.898	(L) (L)	N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG	USD	200'000.00	30.01.2017		35 276 515	%	108.130	100.000	29.07.	7.125	6'874.80	(L)	N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG	CHF	5'000.00	22.03.2017		36 017 271	%	105.700	100.000	22.09.	3.875	96.875	(L)	N
9.1.2017/9.1.2023 ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 lit. i VStG	USD	1'000.00	09.01.2017	09.01.2023	35 265 121	%	101.760	100.000	09.07.	3.574	17.276	(L)	N
9.1.2017/9.1.2023 ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 lit. i VStG	USD	1'000.00	09.01.2017	09.01.2023	35 265 101	%	101.480	100.000	09.07.	3.574	17.276	(L)	N
	USD	1'000.00	14.09.2017	14.12.2023	38 268 786	%	98.910	100.000	14.12.	2.997	7.418		N
	USD	1'000.00	14.09.2017	14.12.2023	38 279 724	%	101.030	100.000	14.12.	VAR.	6.304		N
	USD	1'000.00	14.09.2017	14.12.2023	38 279 730	%	98.890	100.000	14.12.	2.997	7.418		N
	EUR	1'000.00	17.07.2017	17.07.2025	34 336 684	%	100.710	100.000		1.250	0.000		N
	GBP	100'000.00	12.09.2017	12.09.2025	37 926 872	%	99.160	99.797		2.125	0.000		N
9.1.2017/9.1.2028 ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 lit. i VStG	USD	1'000.00	09.01.2017	09.01.2028	35 265 124	%	104.260	100.000	09.07.	4.282	20.699	(L)	N
9.1.2017/9.1.2028 ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 lit. i VStG	USD	1'000.00	09.01.2017	09.01.2028	35 265 102	%	103.840	100.000	09.07.	4.282	20.699	(L)	N
CRH Finance Switzerland AG, Baar, Schweiz													
	CHF	5'000.00	30.09.2014	30.09.2022	25 359 273	%	104.500	100.989	30.09.	1.375	68.750		N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	 %	 Brutto brut lordo CHF		IUP
Dätwyler Holding AG, Altdorf, Schweiz													
	CHF	5'000.00	07.12.2012	07.06.2018	20 029 554	%	100.510	100.500	07.06.	1.125	56.250		N
dormakaba Finance AG, Rümlang, Schweiz													
	CHF	5'000.00	13.10.2017	13.10.2021	38 462 988	%	100.650	100.298		0.375	0.000		N
	CHF	5'000.00	13.10.2017	13.10.2025	38 462 989	%	101.800	100.460		1.000	0.000		N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF		IUP
EBM Netz AG, Muenchenstein, Schweiz													
	CHF	5'000.00	08.02.2017	08.08.2022	35 003 045	%	100.000	100.000	08.08.	0.250	6.250		N
EFIA - Emissions- und Finanz AG, Basel, Schweiz													
	CHF	5'000.00	06.05.2016	06.05.2021	32 094 490	%	100.050	100.000	06.05.	0.375	18.750		N
	CHF	5'000.00	11.07.2017	11.07.2022	36 720 498	%	100.000	100.000		0.450	0.000		N
Einwohnergemeinde Köniz, Schweiz													
	CHF	5'000.00	10.07.2015	10.07.2025	28 595 786	%	100.450	100.862	10.07.	0.875	43.750		N
Elsevier Finance SA, Neuchâtel, Schweiz													
	CHF	5'000.00	18.06.2013	18.12.2018	21 218 405	%	101.190	100.483	18.12.	1.000	50.000		N
Emmi Finanz AG, Luzern, Schweiz													
	CHF	5'000.00	30.06.2011	30.06.2017	13 194 685		-	100.545	30.06.	2.125	106.25		N
	CHF	5'000.00	21.06.2017	21.06.2019	36 869 774	%	100.750	100.800	21.09.	VAR.	0.000		N
									21.12.		0.000		
	CHF	5'000.00	12.07.2013	12.07.2023	21 492 608	%	108.200	100.262	12.07.	1.625	81.250		N
	CHF	5'000.00	21.06.2017	21.06.2029	36 869 775	%	99.850	100.408		0.500	0.000		N
Emosson SA (Electricité d'), Martigny, Schweiz													
	CHF	5'000.00	26.10.2005	26.10.2017	2 284 322		-	100.200	26.10.	2.250	112.50		N
	CHF	5'000.00	02.05.2017	02.11.2022	36 017 275	%	101.500	100.000	02.11.	1.375	34.375		N
Em.Zentrale für gemeinnützige Wohnbauträger, Schweiz													
	CHF	5'000.00	22.06.2017	22.06.2032	36 153 296	%	99.650	101.246		0.375	0.000		N
ENAG Energiefinanzierungs AG, Schwyz, Schweiz													
	CHF	5'000.00	14.06.2013	14.12.2018	21 492 582	%	100.500	100.255	14.12.	1.000	50.000		N
	CHF	5'000.00	31.01.2011	31.01.2023	12 252 660	%	103.550	100.905	31.01.	2.625	131.25		N
Engadiner Kraftwerke AG, Zernez, Schweiz													
	CHF	5'000.00	02.03.2015	02.03.2022	26 683 612	%	98.900	100.035	02.03.	0.125	6.250		N
	CHF	5'000.00	25.04.2014	25.04.2024	24 010 977	%	105.700	100.107	25.04.	1.625	81.250		N
Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial, Basel, Schweiz													
	CHF	5'000.00	10.11.2009	10.11.2017	10 316 504		-	100.220	10.11.	2.125	106.25		N
	CHF	5'000.00	30.12.2003	28.12.2018	1 741 031	%	103.930	100.350	28.12.	3.250	162.50		N
	AUD	5'000.00	29.01.2014	29.01.2019	23 469 582	%	101.770	99.463	29.01.	4.000	75.985	(L)	N
									29.07.		76.398	(L)	
	EUR	1'000.00	21.10.2004	21.10.2019	1 977 536	%	108.140	99.676	21.10.	4.375	50.655	(L)	N
	CAD	5'000.00	13.12.2004	13.12.2019	2 023 564	%	105.590	99.607	13.06.	5.150	94.012	(L)	N
									13.12.		99.344	(L)	
	USD	1'000.00	29.05.2015	29.05.2020	28 362 691	%	98.920	99.477	29.05.	1.750	17.084	(L)	N
	AUD	5'000.00	30.06.2005	30.06.2020	2 208 366	%	107.310	97.903	30.06.	5.500	100.72	(L)	N
									30.12.		105.08	(L)	
	CHF	5'000.00	03.08.2005	03.08.2020	2 206 150	%	107.300	100.040	03.08.	2.375	118.75		N
	CHF	5'000.00	29.06.2004	29.12.2020	1 871 234	%	111.300	101.120	29.12.	3.375	168.75		N
	CHF	5'000.00	30.06.2014	30.06.2021	24 553 679	%	103.400	100.921	30.06.	0.625	31.250		N
	EUR	1'000.00	27.10.2009	27.10.2021	10 680 357	%	114.670	99.532	27.10.	4.000	46.302	(L)	N
	EUR	1'000.00	15.11.2010	15.11.2022	11 979 668	%	113.780	99.783	15.11.	3.125	36.498	(L)	N
	CHF	5'000.00	22.05.2007	22.05.2024	3 065 391	%	119.500	100.978	22.05.	3.000	150.00		N
	CHF	5'000.00	15.05.2006	15.05.2026	2 518 567	%	124.200	100.950	15.05.	3.000	150.00		N
	CAD	10'000.00	30.03.2007	30.03.2027	3 033 294	%	111.030	99.935	30.03.	4.550	169.09	(L)	N
									30.09.		178.63	(L)	
	CHF	5'000.00	04.02.2005	04.02.2030	2 046 907	%	129.900	100.060	04.02.	2.875	143.75		N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	 %	 Brutto brut lordo CHF		IUP
FCA Capital Suisse SA, Schlieren, Schweiz													
	CHF	5'000.00	25.07.2014	25.07.2017	24 854 287		-	100.277	25.07.	1.500	75.000		N
	CHF	5'000.00	25.07.2017	24.07.2020	37 094 362	%	100.100	100.068		0.200	0.000		N
	CHF	5'000.00	29.06.2016	29.11.2021	32 637 141	%	100.950	100.255	29.11.	0.750	37.500		N
First Swiss Mobility 2017-1 Ltd., Zürich, Schweiz													
	CHF	5'000.00	13.04.2017	16.04.2027	35 748 321	%	100.600	100.000		0.140	0.000		N
	CHF	100'000.00	13.04.2017	16.04.2027	35 748 323	%	102.450	100.000		2.750	0.000		N
	CHF	100'000.00	13.04.2017	16.04.2027	35 748 322	%	99.700	100.000		1.750	0.000		N
First Swiss Mobility 2017-2 Ltd., Zürich, Schweiz													
	CHF	100'000.00	28.11.2017	22.11.2027	38 960 604	%	99.950	100.000		0.000	0.000		N
Flughafen Zürich AG, Kloten, Schweiz													
	CHF	5'000.00	05.05.2011	05.05.2017	12 904 077		-	100.200	05.05.	2.250	112.50		N
	CHF	5'000.00	03.07.2012	03.07.2020	18 769 436	%	103.700	100.173	03.07.	1.250	62.500		N
	CHF	5'000.00	17.04.2013	17.04.2023	21 036 279	%	107.650	100.906	17.04.	1.500	75.000		N
	CHF	5'000.00	24.05.2017	24.05.2029	36 153 287	%	101.100	100.578		0.625	0.000		N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Galenica AG, Bern, Schweiz												
	CHF	5'000.00	15.06.2017	15.06.2023	36 720 669	%	100.300	100.488		0.500	0.000	N
	CHF	5'000.00	15.06.2017	15.12.2026	36 720 670	%	102.250	100.532	15.12.	1.000	25.000	N
Geberit AG, Rapperswil-Jona, Schweiz												
	CHF	5'000.00	17.04.2015	17.04.2019	27 623 764	%	100.400	100.000	17.04.	0.050	2.500	N
	CHF	5'000.00	17.04.2015	17.04.2023	27 623 766	%	100.700	100.000	17.04.	0.300	15.000	N
Genève (Canton de), Genève, Schweiz												
	CHF	5'000.00	29.05.2012	29.05.2017	18 491 190		-	100.255	29.05.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	27.11.2009	27.11.2019	10 684 844	%	105.750	100.744	27.11.	2.500	125.00	N
	CHF	5'000.00	15.06.2010	15.06.2020	11 348 016	%	106.400	100.520	15.06.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	22.02.2011	22.02.2021	12 359 099	%	108.250	101.016	22.02.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	30.07.2014	30.07.2021	24 775 436	%	103.400	100.597	30.07.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	06.04.2010	06.04.2022	11 119 113	%	111.800	100.265	06.04.	2.500	125.00	N
	CHF	5'000.00	26.10.2012	26.10.2022	19 469 520	%	105.700	100.485	26.10.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	29.05.2012	29.12.2022	18 491 195	%	107.200	100.558	29.12.	1.250	62.500	N
	CHF	5'000.00	22.03.2013	22.03.2023	20 832 344	%	107.250	101.007	22.03.	1.250	62.500	N
	CHF	5'000.00	28.11.2011	28.11.2023	14 213 200	%	110.200	101.097	28.11.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	14.10.2011	14.10.2024	13 945 872	%	110.400	100.985	14.10.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	27.11.2015	27.11.2024	30 279 013	%	100.200	100.000	27.11.	0.020	1.000	N
	CHF	5'000.00	20.09.2013	20.03.2026	22 205 092	%	115.300	100.714	20.03.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	29.09.2014	29.09.2026	24 948 365	%	107.250	100.722	29.09.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	26.10.2012	26.10.2026	19 469 521	%	109.600	100.086	26.10.	1.250	62.500	N
	CHF	5'000.00	29.05.2012	28.05.2027	18 491 196	%	112.200	100.353	28.05.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	29.11.2017	29.11.2027	38 787 903	%	100.300	100.346		0.250	0.000	N
	CHF	5'000.00	27.01.2012	27.01.2028	14 213 203	%	112.400	101.409	27.01.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	27.10.2010	27.10.2028	11 469 542	%	119.400	101.069	27.10.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	30.07.2014	30.07.2029	24 775 438	%	114.500	101.049	30.07.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	20.09.2013	20.09.2029	22 205 093	%	121.800	101.471	20.09.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	27.11.2015	27.11.2030	30 279 014	%	101.000	100.470	27.11.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	29.11.2017	28.11.2031	38 787 904	%	100.600	100.103		0.500	0.000	N
	CHF	5'000.00	05.03.2012	05.03.2032	14 931 705	%	114.050	100.950	05.03.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	22.03.2013	22.03.2033	20 832 345	%	118.200	101.328	22.03.	1.750	87.500	N
	CHF	5'000.00	24.05.2013	24.05.2034	21 245 956	%	118.700	102.189	24.05.	1.750	87.500	N
	CHF	5'000.00	29.09.2014	29.09.2034	24 948 366	%	112.800	100.171	29.09.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	28.04.2016	28.04.2036	31 559 392	%	96.700	100.000	28.04.	0.400	20.000	N
	CHF	5'000.00	24.03.2017	24.03.2038	35 865 494	%	98.900	100.890		0.550	0.000	N
	CHF	5'000.00	06.12.2013	06.12.2038	22 867 493	%	131.500	100.666	06.12.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	28.11.2011	28.11.2041	14 233 769	%	129.650	102.647	28.11.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	04.07.2016	04.07.2046	32 621 392	%	96.800	101.240	04.07.	0.600	30.000	N
	CHF	5'000.00	31.10.2016	31.10.2056	34 172 591	%	90.150	100.000	31.10.	0.500	25.000	N
Genève (Ville de), Genève, Schweiz												
	CHF	5'000.00	17.04.2013	17.04.2023	20 978 203	%	105.950	100.164	17.04.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	12.12.2013	12.12.2024	22 797 649	%	110.950	100.890	12.12.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	12.02.2015	12.02.2025	26 785 600	%	100.400	100.429	12.02.	0.125	6.250	N
	CHF	5'000.00	19.11.2012	19.11.2029	19 941 999	%	110.100	101.767	20.11.	1.375	68.940	N
Genossenschaft Emissionszentrale fuer gemeinnuetzige Wohnbautraeger EGW, Olten, Schweiz												
	CHF	5'000.00	26.06.2009	26.06.2017	10 235 674		-	100.910	26.06.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	19.09.2005	19.09.2017	2 265 322		-	101.625	19.09.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	12.01.2006	12.01.2018	2 371 016	%	100.070	100.400	12.01.	2.375	118.75	N
	CHF	5'000.00	20.05.2008	18.05.2018	3 985 249	%	101.610	101.750	18.05.	3.500	175.00	N
	CHF	5'000.00	27.11.2009	27.11.2019	10 696 275	%	105.750	101.586	27.11.	2.500	125.00	N
	CHF	5'000.00	02.05.2005	30.04.2020	2 124 796	%	107.500	102.800	30.04.	2.750	137.50	N
	CHF	5'000.00	04.11.2010	04.11.2020	11 853 152	%	106.150	101.075	04.11.	1.750	87.500	N
	CHF	5'000.00	03.12.2012	24.03.2023	20 037 021	%	105.400	101.730	24.03.	0.875	43.750	N
	CHF	5'000.00	24.07.2013	24.07.2023	21 757 977	%	108.350	100.518	24.07.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	24.09.2014	24.09.2024	25 324 334	%	105.450	101.352	24.09.	0.750	37.500	N
	CHF	5'000.00	27.05.2015	27.05.2025	28 073 751	%	101.000	100.448	27.05.	0.125	6.250	N
	CHF	5'000.00	14.09.2011	14.09.2026	13 661 180	%	114.550	102.070	14.09.	1.750	87.500	N
	CHF	5'000.00	15.06.2012	15.06.2027	18 575 416	%	110.750	101.729	15.06.	1.250	62.500	N
	CHF	5'000.00	27.03.2013	27.03.2028	20 820 058	%	112.250	101.423	27.03.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	24.07.2013	24.07.2028	21 757 978	%	116.350	101.442	24.07.	1.750	87.500	N
	CHF	5'000.00	08.05.2014	08.05.2029	24 219 397	%	115.550	102.416	08.05.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	24.09.2014	24.09.2029	25 324 335	%	110.050	102.160	24.09.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	27.05.2015	27.05.2030	28 073 754	%	100.950	100.658	27.05.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	09.12.2016	09.12.2031	34 458 383	%	100.400	101.317	09.12.	0.400	20.000	N
	CHF	5'000.00	07.09.2015	07.09.2033	29 236 508	%	102.700	101.334	07.09.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	14.09.2017	14.09.2035	36 153 316	%	101.800	101.700		0.600	0.000	N
	CHF	5'000.00	09.05.2016	09.05.2036	31 251 273	%	96.700	101.659	09.05.	0.320	16.000	N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF		IUP
Georg Fischer Finanz AG, Schaffhausen, Schweiz													
	CHF	5'000.00	12.09.2013	12.09.2018	22 138 613	%	101.360	100.271	12.09.	1.500	75.000		N
	CHF	5'000.00	12.09.2013	12.09.2022	22 138 614	%	110.050	100.133	12.09.	2.500	125.00		N
	CHF	5'000.00	12.05.2016	12.05.2026	31 941 596	%	101.900	100.143	12.05.	0.875	43.750		N
Givaudan SA, Vernier, Schweiz													
	CHF	5'000.00	15.06.2011	15.06.2018	13 043 399	%	101.380	100.649	15.06.	2.500	125.00		N
	CHF	5'000.00	19.03.2014	18.09.2020	23 755 208	%	103.350	100.536	18.09.	1.000	50.000		N
	CHF	5'000.00	07.12.2011	07.12.2021	14 298 194	%	108.200	100.051	07.12.	2.125	106.25		N
	CHF	5'000.00	07.12.2016	07.12.2022	34 336 677	%	100.000	100.060	07.12.	0.000	0.000		N
	CHF	5'000.00	19.03.2014	19.03.2024	23 755 210	%	109.500	101.156	19.03.	1.750	87.500		N
	CHF	5'000.00	07.12.2016	05.12.2031	34 336 678	%	98.850	100.146	05.12.	0.625	31.076		N
Glarner Kantonalbank, Glarus, Schweiz													
	CHF	5'000.00	19.12.2012		20 121 551	%	100.500	101.000	19.03.	3.500	175.00		N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG	CHF	5'000.00	27.11.2015		30 345 281	%	103.100	100.000	27.01.	1.759	87.950	(L)	N
	CHF	5'000.00	04.10.2013	04.10.2019	22 331 195	%	102.450	100.059	04.10.	1.000	50.000		N
	CHF	5'000.00	21.09.2012	21.09.2022	19 326 599	%	104.850	100.108	21.09.	1.000	50.000		N
	CHF	5'000.00	28.04.2017	26.09.2025	35 767 623	%	99.850	100.134	26.09.	0.150	3.083		N
	CHF	5'000.00	26.02.2015	26.02.2027	26 969 917	%	100.650	100.235	26.02.	0.375	18.750		N
Grande Dixence SA, Sion, Schweiz													
	CHF	5'000.00	27.09.2007	27.09.2017	3 358 527		-	100.834	27.09.	3.375	168.75		N
	CHF	5'000.00	10.06.2011	10.06.2021	12 248 841	%	104.900	100.200	10.06.	2.375	118.75		N
	CHF	5'000.00	12.05.2016	12.05.2022	31 941 597	%	102.700	100.000	12.05.	1.750	87.500		N
	CHF	5'000.00	04.07.2017	04.07.2024	36 153 295	%	99.500	100.134		1.125	0.000		N
	CHF	5'000.00	18.02.2015	18.02.2025	26 288 319	%	100.300	100.816	18.02.	1.375	68.750		N
Graubünden, Schweiz													
	CHF	5'000.00	26.11.2015	26.11.2027	30 319 614	%	100.950	100.890	26.11.	0.250	12.500		N
Graubündner Kantonalbank, Chur, Schweiz													
	CHF	5'000.00	08.02.2010	08.02.2017	10 896 391		-	100.750	08.02.	2.000	100.00		N
	CHF	5'000.00	14.06.2012	14.06.2019	18 647 249	%	101.800	100.934	14.06.	0.750	37.500		N
	CHF	5'000.00	08.05.2014	07.05.2021	24 315 488	%	103.500	100.198	07.05.	0.750	37.500		N
	CHF	5'000.00	14.06.2012	14.06.2024	18 647 282	%	107.750	101.272	14.06.	1.250	62.500		N
	CHF	5'000.00	11.03.2013	11.03.2025	20 689 474	%	109.250	100.900	11.03.	1.375	68.750		N
	CHF	5'000.00	10.03.2016	10.03.2028	31 251 264	%	99.050	100.266	10.03.	0.250	12.500		N
	CHF	5'000.00	20.04.2015	20.04.2029	27 642 381	%	102.350	100.704	20.04.	0.625	31.250		N
	CHF	5'000.00	30.09.2011	30.09.2041	13 799 280	%	126.590	100.388	30.09.	2.000	100.00		N
GRENKELEASING SA, Zürich, Schweiz													
	CHF	5'000.00	15.09.2017	15.09.2020	38 036 006	%	100.350	100.134		0.450	0.000		N
Groupe Acrotec AG, Develier, Schweiz													
	CHF	5'000.00	14.06.2017	14.06.2023	36 720 672	%	103.500	100.000		3.750	0.000		N
GZO AG Spital Wetzikon, Wetzikon, Schweiz													
	CHF	5'000.00	12.06.2014	12.06.2024	24 010 961	%	110.000	101.076	12.06.	1.875	93.750		N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF		IUP
HBM Healthcare Investments AG, Zug, Schweiz													
	CHF	5'000.00	10.07.2015	10.07.2021	28 372 680	%	103.200	100.000	10.07.	2.000	100.00		N
	CHF	5'000.00	10.07.2015	10.07.2023	28 372 681	%	104.150	100.000	10.07.	2.500	125.00		N
HDLT HOLDING SA - Hopital de la Tour, Genève, Schweiz													
	CHF	5'000.00	30.11.2015	30.06.2022	29 947 738	%	101.700	100.000	30.06.	2.500	125.00		N
HELVETIA ENVIRONNEMENT GROUPE SA, Carouge, Schweiz													
	CHF	5'000.00	26.07.2017	26.07.2022	37 094 357	%	103.850	100.000		3.625	0.000		N
Helvetia Holding AG, St.Gallen, Schweiz													
	CHF	5'000.00	08.04.2013	08.04.2019	20 947 206	%	101.800	100.514	08.04.	1.125	56.250		N
Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG, St.Gallen, Schweiz													
	CHF	5'000.00	17.10.2014		25 589 308	%	105.600	101.000	17.04.	3.500	175.00		N
	CHF	5'000.00	23.09.2015		29 298 443	%	106.350	100.000	23.11.	3.000	150.00		N
	CHF	5'000.00	28.10.2014	28.10.2020	25 589 311	%	102.350	100.175	28.10.	0.750	37.500		N
	CHF	5'000.00	28.10.2014	28.04.2025	25 589 312	%	107.950	100.536	28.04.	1.500	75.000		N
	CHF	5'000.00	17.10.2014	17.10.2044	25 589 309	%	113.750	101.000	17.10.	4.000	200.00		N
Hero, Lenzburg, Schweiz													
	CHF	5'000.00	28.10.2016		34 172 587	%	101.000	100.000	27.10.	2.125	105.95		N
	CHF	5'000.00	26.06.2013	26.06.2020	21 488 315	%	102.150	100.111	26.06.	1.250	62.500		N
	CHF	5'000.00	28.10.2016	28.10.2026	34 172 588	%	99.900	100.000	28.10.	1.000	50.000		N
HIAG Immobilien Holding AG, Basel, Schweiz													
	CHF	5'000.00	01.07.2015	01.07.2021	28 460 739	%	102.050	100.582	01.07.	1.000	50.000		N
	CHF	5'000.00	30.05.2017	30.05.2022	36 274 830	%	101.200	100.208		0.800	0.000		N
	CHF	5'000.00	04.07.2016	04.07.2023	32 637 142	%	101.300	100.320	04.07.	1.000	50.000		N
Hinterrhein AG (Kraftwerke), Thusis, Schweiz													
	CHF	5'000.00	28.07.2010	28.07.2022	11 483 926	%	108.600	100.550	28.07.	2.375	118.75		N
Hirslanden AG, Opfikon, Schweiz													
	CHF	5'000.00	25.02.2015	25.02.2021	26 969 877	%	103.700	100.000	25.02.	1.625	81.250		N
	CHF	5'000.00	25.02.2015	25.02.2025	26 969 879	%	104.600	100.000	25.02.	2.000	100.00		N
Hochdorf Holding AG, Hochdorf, Schweiz													
Anleihe 2017-ohne festen Verfall Def Cpn Fix/Variabler Zinssatz	CHF	5'000.00	21.12.2017		39 164 798	%	98.300	100.000		2.500	0.000		N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Implenia AG, Dietlikon, Schweiz												
	CHF	5'000.00	15.10.2014	15.10.2024	25 359 276	%	108.000	101.063	15.10.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	21.03.2016	20.03.2026	31 699 466	%	102.450	100.739	20.03.	1.000	49.861	N
Intershop Holding AG, Zürich, Schweiz												
	CHF	5'000.00	14.02.2014	14.02.2019	23 483 367	%	101.640	100.663	14.02.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	17.04.2015	17.04.2023	27 577 643	%	103.900	100.764	17.04.	1.125	56.250	N
Investis Holding AG, Zürich, Schweiz												
	CHF	5'000.00	14.02.2017	14.02.2019	35 259 586	%	100.200	100.065		0.250	0.000	N
	CHF	5'000.00	15.11.2016	15.11.2021	33 764 551	%	100.300	100.209	15.11.	0.550	27.500	N
	CHF	5'000.00	03.10.2017	03.10.2022	36 153 322	%	100.200	100.098		0.750	0.000	N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	 %	Brutto brut lordo CHF		IUP
Julius Bär Gruppe AG, Zürich, Schweiz													
	CHF	5'000.00	18.09.2012		19 443 766	%	101.000	101.000	19.03.	3.875	193.75		N
	CHF	5'000.00	05.06.2014		24 010 960	%	106.500	101.000	05.06.	4.250	150.00	(L)	N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG													
	USD	1'000.00	12.09.2017		38 205 293	%	100.000	100.000		4.750	0.000		N
	CHF	5'000.00	06.12.2017	06.12.2024	37 347 621	%	100.550	100.675		0.375	0.000		N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Kanton Aargau, Aarau, Schweiz												
Tranche 1	CHF	5'000.00	11.12.2015	10.12.2021	30 595 452	%	101.300	103.052	10.12.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	17.02.2017	17.02.2022	35 342 804	%	101.350	102.306		0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	15.12.2010	15.12.2028	11 985 865	%	119.450	101.100	15.12.	2.000	100.00	N
Tranche 2	CHF	5'000.00	11.12.2015	11.12.2029	30 595 456	%	100.000	101.245	11.12.	0.250	12.500	N
	CHF	5'000.00	17.02.2017	17.02.2031	35 342 805	%	101.000	101.302		0.375	0.000	N
Kanton Appenzell Ausserrhoden, Schweiz												
	CHF	5'000.00	15.07.2014	15.07.2019	24 469 256	%	101.150	100.463	15.07.	0.250	12.500	N
Kanton Basel-Stadt, Basel, Schweiz												
	CHF	5'000.00	29.08.2012	29.08.2017	19 294 108		-	100.286	29.08.	0.125	6.250	N
	CHF	5'000.00	28.11.2013	28.11.2018	22 734 316	%	101.070	100.439	28.11.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	01.06.2010	31.05.2019	11 293 375	%	103.490	100.440	31.05.	1.875	93.750	N
	CHF	5'000.00	31.01.2008	31.01.2020	3 670 296	%	107.900	101.040	31.01.	3.250	162.50	N
	CHF	5'000.00	24.11.2016	24.11.2021	34 553 651	%	101.300	102.281	24.11.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	28.01.2016	28.01.2022	31 017 550	%	101.200	101.132	28.01.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	05.09.2016	05.09.2023	33 145 532	%	100.950	102.943	05.09.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	23.11.2017	22.11.2024	35 357 432	%	100.400	100.740		0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	05.09.2016	04.09.2026	33 145 533	%	99.450	102.392	04.09.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	05.09.2016	05.09.2029	33 145 534	%	97.350	101.586	05.09.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	23.02.2015	23.02.2035	26 810 022	%	100.400	100.095	23.02.	0.500	25.000	N
Kanton Schwyz, Schweiz												
	CHF	5'000.00	22.01.2016	20.01.2023	30 725 641	%	101.150	100.812	20.01.	0.000	0.000	N
Kanton Solothurn, Solothurn, Schweiz												
	CHF	5'000.00	29.11.2012	29.11.2019	19 977 322	%	101.800	100.488	29.11.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	15.12.2014	15.12.2021	26 051 575	%	102.750	101.061	15.12.	0.375	18.750	N
Tranche 1	CHF	5'000.00	16.10.2015	16.10.2023	29 734 355	%	100.900	100.000	16.10.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	15.12.2014	13.12.2024	26 051 576	%	104.800	100.250	13.12.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	25.10.2017	27.10.2025	37 926 875	%	99.950	100.000	27.10.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	29.11.2012	29.11.2027	19 977 323	%	109.750	100.676	29.11.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	16.12.2016	15.12.2028	34 458 384	%	99.800	100.417	15.12.	0.200	9.972	N
Tranche 2	CHF	5'000.00	16.10.2015	16.10.2030	29 734 356	%	102.300	100.195	16.10.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	02.12.2013	02.12.2038	22 813 827	%	128.900	101.169	02.12.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	02.12.2013	02.12.2043	22 813 828	%	133.250	100.448	02.12.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	20.02.2015	20.02.2045	27 037 380	%	110.200	101.562	20.02.	1.000	50.000	N
Kanton St. Gallen, St. Gallen, Schweiz												
	CHF	5'000.00	09.04.1998	09.04.2018	867 320	%	101.200	100.750	09.04.	3.750	187.50	N
	CHF	5'000.00	03.02.2004	03.02.2020	1 764 020	%	107.700	100.380	03.02.	3.125	156.25	N
	CHF	5'000.00	18.07.2013	18.07.2028	21 782 531	%	116.550	101.340	18.07.	1.750	87.500	N
	CHF	5'000.00	18.07.2013	16.07.2038	21 782 533	%	128.400	102.105	17.07.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	28.11.2016	28.11.2041	34 258 764	%	90.950	100.244	28.11.	0.200	10.000	N
Kanton Thurgau, Schweiz												
	CHF	5'000.00	12.06.2015	12.06.2025	28 183 548	%	103.000	100.639	12.06.	0.375	18.750	N
Kantonsspital Aarau AG, Aarau, Schweiz												
	CHF	5'000.00	29.05.2017	28.05.2032	36 153 290	%	103.700	100.747		0.750	0.000	N
Kinderspital Zürich - Eleonorenstiftung, Zürich, Schweiz												
	CHF	5'000.00	28.07.2016	28.07.2028	32 621 391	%	99.450	100.385	28.07.	0.250	12.500	N
	CHF	5'000.00	28.07.2016	28.07.2036	32 621 395	%	103.800	102.059	28.07.	0.750	37.500	N
Kraftwerk Amsteg AG, Silenen, Schweiz												
	CHF	5'000.00	09.03.2006	09.03.2018	2 440 271	%	100.540	100.130	09.03.	2.375	118.75	N
Kraftwerke Linth-Limmern AG (KLL), Glarus Sued, Schweiz												
	CHF	5'000.00	10.03.2010	10.03.2017	11 011 856		-	100.666	10.03.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	09.09.2015	09.09.2021	29 087 649	%	100.250	100.088	09.09.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	10.03.2010	10.03.2022	11 011 857	%	107.650	100.297	10.03.	2.750	137.50	N
	CHF	5'000.00	06.06.2016	06.12.2022	31 940 370	%	104.100	100.000	06.12.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	10.06.2011	09.06.2023	13 050 130	%	108.100	101.258	09.06.	2.750	137.50	N
	CHF	5'000.00	10.03.2017	11.12.2023	35 748 316	%	103.550	100.000	11.12.	2.000	75.277	N
	CHF	5'000.00	11.09.2014	11.09.2024	25 270 305	%	100.850	100.424	11.09.	1.250	62.500	N
	CHF	5'000.00	10.12.2013	10.12.2026	22 853 143	%	103.750	100.222	10.12.	2.375	118.75	N
	CHF	5'000.00	30.06.2011	30.06.2031	13 216 343	%	104.100	100.231	30.06.	2.875	143.75	N
	CHF	5'000.00	27.03.2012	27.03.2042	18 042 853	%	96.150	100.751	27.03.	2.875	143.75	N
	CHF	5'000.00	02.04.2013	02.04.2048	20 827 154	%	97.600	102.557	02.04.	3.000	150.00	N
	CHF	5'000.00	27.09.2012	27.09.2052	19 495 896	%	96.250	101.112	27.09.	3.000	150.00	N
Kraftwerke Oberhasli AG, Innertkirchen, Schweiz												
	CHF	5'000.00	04.04.2005	04.04.2017	2 089 994		-	101.070	04.04.	2.750	137.50	N
	CHF	5'000.00	21.02.2013	21.02.2025	20 004 480	%	108.950	100.381	21.02.	1.875	93.750	N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF		IUP
	CHF	5'000.00	30.01.2017	30.01.2026	35 003 042	%	102.300	100.523		0.700	0.000		N
Kudelski SA, Cheseaux-sur-Lausanne, Schweiz													
	CHF	5'000.00	12.05.2015	12.08.2022	28 069 593	%	102.200	100.000	12.08.	1.875	93.750		N
	CHF	5'000.00	27.09.2016	27.09.2024	33 635 280	%	100.100	100.000	27.09.	1.500	75.000		N
Kuoni Reisen Holding AG, Zürich, Schweiz													
	CHF	5'000.00	28.10.2013	28.10.2019	22 294 867		-	100.194	15.06. 28.10. 22.12.	1.500	53.130 75.000 11.250		N
15.6.2017 Rückkauf ausstehender Titel: 5'000 = CHF 5'153.13 in bar 22.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung													

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF		IUP
LafargeHolcim Ltd, Rapperswil-Jona, Schweiz													
	CHF	5'000.00	20.02.2007	20.02.2017	2 894 560		-	100.240	20.02.	3.125	156.25		N
	CHF	5'000.00	11.09.2009	11.09.2018	10 520 299	%	103.020	100.675	11.09.	4.000	200.00		N
	CHF	5'000.00	04.12.2015	03.12.2021	30 617 909	%	100.850	100.106	03.12.	0.375	18.750		N
	CHF	5'000.00	09.12.2013	09.06.2022	22 853 145	%	107.400	100.870	09.06.	2.000	100.00		N
	CHF	5'000.00	22.06.2012	22.11.2022	18 721 890	%	113.050	101.286	22.11.	3.000	150.00		N
	CHF	5'000.00	04.12.2015	04.12.2025	30 617 912	%	103.150	100.190	04.12.	1.000	50.000		N
L'Aubier SA, Rochefort, Schweiz													
	CHF	10'000.00	30.04.2012	30.04.2017	18 675 000		-	101.000	30.04.	2.000	1'000.00		Y
Lausanne, Lausanne, Schweiz													
	CHF	5'000.00	05.11.2013	05.11.2017	22 522 702		-	100.000	06.02. 05.05. 07.08. 05.11.	VAR.	0.000 0.000 0.000 0.000		N
	CHF	5'000.00	29.04.2014	29.04.2022	24 153 096	%	104.750	100.788	29.04.	1.000	50.000		N
	CHF	5'000.00	30.09.2011	30.09.2022	13 852 368	%	108.000	100.910	30.09.	1.625	81.250		N
	CHF	5'000.00	27.11.2013	27.11.2023	22 767 897	%	107.800	100.287	27.11.	1.375	68.750		N
	CHF	5'000.00	07.06.2012	07.06.2024	18 583 136	%	107.400	100.695	07.06.	1.250	62.500		N
	CHF	5'000.00	02.04.2013	03.04.2028	20 900 234	%	111.300	100.483	03.04.	1.500	75.000		N
	CHF	5'000.00	02.03.2015	04.03.2030	27 058 620	%	101.400	101.734	04.03.	0.625	31.250		N
	CHF	5'000.00	04.10.2017	06.10.2042	36 153 323	%	100.400	100.056		0.875	0.000		N
Leibstadt AG (Kernkraftwerk), Leibstadt, Schweiz													
	CHF	5'000.00	31.03.2010	29.03.2019	11 068 071	%	102.530	100.202	29.03.	2.500	125.00		N
	CHF	5'000.00	16.12.2015	16.12.2022	30 474 921	%	102.600	100.132	16.12.	1.500	75.000		N
Lindt & Sprüngli AG (Chocoladefabriken), Kilchberg, Schweiz													
	CHF	5'000.00	08.10.2014	06.10.2017	25 547 527		-	100.000	09.01. 09.04. 09.07. 06.10.	VAR.	0.000 0.000 0.000 0.000		N
	CHF	5'000.00	08.10.2014	08.10.2020	25 547 528	%	101.850	100.544	08.10.	0.500	25.000		N
	CHF	5'000.00	08.10.2014	08.10.2024	25 547 529	%	105.800	100.204	08.10.	1.000	50.000		N
	CHF	5'000.00	06.10.2017	06.10.2027	37 926 869	%	100.000	100.074		0.300	0.000		N
Lonza Swiss Finanz AG, Basel, Schweiz													
	CHF	5'000.00	11.10.2012	11.10.2018	19 506 202	%	101.740	100.209	11.10.	2.000	100.00		N
	CHF	5'000.00	07.12.2011	07.12.2018	14 321 844	%	103.130	100.557	07.12.	3.125	156.25		N
	CHF	5'000.00	10.04.2013	10.04.2019	20 947 463	%	102.180	100.450	10.04.	1.750	87.500		N
	CHF	5'000.00	22.09.2015	22.09.2020	29 317 344	%	101.150	100.135	22.09.	0.625	31.250		N
	CHF	5'000.00	12.07.2017	12.07.2021	36 720 673	%	100.000	100.179		0.200	0.000		N
	CHF	5'000.00	01.11.2016	01.11.2021	34 172 590	%	99.300	100.037	01.11.	0.125	6.250		N
	CHF	5'000.00	11.10.2012	11.10.2022	19 506 203	%	111.750	100.735	11.10.	3.000	150.00		N
	CHF	5'000.00	22.09.2015	22.09.2023	29 317 345	%	103.850	100.133	22.09.	1.250	62.500		N
	CHF	5'000.00	12.07.2017	12.07.2024	36 720 674	%	101.050	100.222		0.700	0.000		N
Lugano, Schweiz													
	CHF	5'000.00	09.12.2013	09.12.2020	22 853 147	%	103.300	100.043	09.12.	0.875	43.750		N
	CHF	5'000.00	01.06.2012	01.06.2022	18 575 435	%	105.500	101.288	01.06.	1.125	56.250		N
	CHF	5'000.00	09.12.2014	09.12.2024	26 154 186	%	105.750	100.941	09.12.	0.875	43.750		N
	CHF	5'000.00	01.09.2015	01.09.2025	29 087 651	%	103.750	100.436	01.09.	0.625	31.250		N
	CHF	5'000.00	20.12.2017	20.12.2027	38 787 908	%	99.700	100.197		0.250	0.000		N
	CHF	5'000.00	20.02.2013	20.02.2043	20 550 001	%	119.750	100.900	20.02.	1.750	87.500		N
Luzern (Kanton), Luzern, Schweiz													
	CHF	5'000.00	15.06.2011	15.06.2027	13 061 488	%	121.150	100.160	15.06.	2.375	118.75		N
	CHF	5'000.00	20.06.2017	20.06.2029	36 830 687	%	98.750	100.238		0.125	0.000		N
	CHF	5'000.00	28.10.2013	28.10.2033	22 458 182	%	124.300	102.144	28.10.	2.000	100.00		N
	CHF	5'000.00	13.06.2013	12.06.2043	21 401 067	%	121.650	100.057	12.06.	1.520	76.000		N
Luzerner Kantonalbank AG, Luzern, Schweiz													
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG	CHF	5'000.00	06.03.2015		26 969 765	%	102.250	100.000	06.03.	1.500	75.000	(L)	N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG	CHF	5'000.00	08.03.2016		31 391 632	%	102.450	100.000	08.03.	1.500	75.000	(L)	N
	CHF	5'000.00	10.09.2009	10.09.2018	10 476 000	%	102.120	100.900	10.09.	2.375	118.75		N
	CHF	5'000.00	05.07.2007	05.07.2019	3 184 756	%	105.900	100.900	05.07.	3.375	168.75		N
	CHF	5'000.00	30.06.2010	30.06.2020	11 426 144	%	105.550	100.300	30.06.	1.875	93.750		N
	CHF	5'000.00	25.11.2005	25.11.2020	2 326 684	%	108.500	101.350	25.11.	2.625	131.25		N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	% %	Brutto brut lordo CHF	IUP
	CHF	5'000.00	27.12.2011	27.12.2021	14 487 327	%	111.100	100.622	27.12.	3.000	150.00	N
	CHF	5'000.00	07.01.2010	07.01.2022	10 799 189	%	110.750	100.500	07.01.	2.500	125.00	N
	CHF	5'000.00	30.01.2015	30.01.2023	26 643 795	%	102.150	100.450	30.01.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	30.06.2014	30.06.2023	24 692 020	%	106.350	100.970	30.06.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	11.03.2005	11.03.2025	2 081 046	%	120.950	101.100	11.03.	3.000	150.00	N
	CHF	5'000.00	11.04.2017	11.04.2025	36 167 726	%	100.900	100.000		0.200	0.000	N
	CHF	5'000.00	15.09.2016	15.09.2031	33 717 231	%	94.550	100.100	15.09.	0.100	5.000	N
	CHF	5'000.00	06.12.2010	06.12.2033	12 038 159	%	121.070	100.000	06.12.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	26.11.2010	26.11.2035	11 998 307	%	120.550	100.303	26.11.	1.875	93.750	N
	CHF	5'000.00	20.07.2012	20.07.2037	18 974 244	%	117.400	102.000	20.07.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	27.12.2010	27.12.2039	12 073 685	%	126.550	100.350	27.12.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	04.10.2011	04.10.2041	13 827 685	%	129.950	101.830	04.10.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	11.03.2011	11.03.2043	12 548 658	%	140.100	101.600	11.03.	2.500	125.00	N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Matterhorn Gotthard Verkehrs AG, Brig, Schweiz												
	CHF	5'000.00	12.04.2012	12.04.2032	14 380 836	%	114.350	101.501	12.04.	1.500	75.000	N
Meyer Burger Technology AG, Thun, Schweiz												
	CHF	5'000.00	24.05.2012	24.05.2017	18 498 778		-	100.375	24.05.	5.000	250.00	N
Migros-Genossenschafts-Bund (MGB), Zürich, Schweiz												
	CHF	5'000.00	03.05.2011	03.05.2017	11 760 647		-	101.050	03.05.	2.000	100.00	N
Mobimo Holding AG, Luzern, Schweiz												
	CHF	5'000.00	29.10.2013	29.10.2018	22 492 349	%	101.440	100.271	29.10.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	19.05.2014	19.05.2021	24 298 406	%	104.850	100.012	19.05.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	16.09.2014	16.09.2024	25 237 980	%	108.950	100.673	16.09.	1.875	93.750	N
	CHF	5'000.00	20.03.2017	20.03.2026	35 483 611	%	100.350	100.435		0.750	0.000	N
MSC Cruises SA, Genève, Schweiz												
	CHF	5'000.00	30.11.2016	30.11.2021	34 172 589	%	102.000	100.000	30.11.	3.000	150.00	N
	CHF	5'000.00	14.07.2017	14.07.2023	37 094 356	%	101.200	100.000		3.000	0.000	N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Nant de Drance SA, Finhaut, Schweiz												
	CHF	5'000.00	15.02.2013	15.02.2021	20 004 477	%	102.950	100.500	15.02.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	23.10.2015	23.10.2023	29 298 447	%	101.450	100.303	23.10.	1.250	62.500	N
	CHF	5'000.00	18.07.2014	18.07.2024	24 569 153	%	102.750	100.605	18.07.	1.750	87.500	N
	CHF	5'000.00	02.02.2016	02.02.2026	30 662 622	%	102.100	100.315	02.02.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	15.02.2013	15.02.2028	20 004 478	%	104.250	100.228	15.02.	2.375	118.75	N
Neuchâtel (Canton de), Neuchâtel, Schweiz												
	CHF	5'000.00	10.11.2015	11.11.2024	30 041 727	%	100.650	100.043	11.11.	0.040	2.000	N
	CHF	5'000.00	24.09.2012	24.09.2027	19 339 553	%	109.850	100.003	24.09.	1.250	62.500	N
	CHF	5'000.00	23.11.2017	23.11.2037	38 599 711	%	101.600	100.317		0.700	0.000	N
Nidwaldner Kantonalbank, Stans, Schweiz												
	CHF	5'000.00	27.05.2016	27.05.2026	31 940 376	%	100.400	100.942	27.05.	0.250	12.500	N
Notenstein La Roche Privatbank AG, St.Gallen, Schweiz												
Tracker Certificate auf Obligationen	USD	100.00	20.06.2013	17.02.2017	20 711 895		-	100.000		0.000	0.000	Y
Novartis AG, Basel, Schweiz												
	CHF	5'000.00	13.02.2015	13.05.2025	27 019 098	%	101.000	100.640	13.05.	0.250	12.500	N
	CHF	5'000.00	13.02.2015	13.11.2029	27 019 099	%	102.350	100.502	13.11.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	13.02.2015	11.05.2035	27 019 100	%	104.500	100.479	11.05.	1.050	52.500	N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	 %	 Brutto brut lordo CHF		IUP
OC Oerlikon Corporation AG, Freienbach, Schweiz													
	CHF	5'000.00	17.06.2014	17.06.2019	24 469 252	%	101.850	100.462	17.06.	1.250	62.500		N
	CHF	5'000.00	17.06.2014	17.06.2024	24 469 253	%	114.200	101.064	17.06.	2.625	131.25		N
Orior AG, Zürich, Schweiz													
	CHF	5'000.00	26.09.2017	26.09.2023	37 961 096	%	100.750	100.545		0.625	0.000		N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Pargesa Holding SA, Genève, Schweiz												
	CHF	5'000.00	10.12.2013	10.12.2018	22 476 154	%	101.640	100.249	10.12.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	24.04.2015	24.04.2024	26 898 815	%	102.000	100.605	24.04.	0.875	43.750	N
Partners Group Holding AG, Baar, Schweiz												
	CHF	5'000.00	07.06.2017	07.06.2024	36 153 289	%	99.350	100.052		0.150	0.000	N
Peach Property Group AG, Zürich, Schweiz												
	CHF	1'000.00	15.12.2015		30 571 164	%	100.300	100.000	15.12.	5.000	50.000	N
3 % Wandelanleihe 2017-ohne festen Verfall Reg S	CHF	1'000.00	04.10.2017		38 195 225	%	109.500	100.000		3.000	0.000	N
Pfandbriefbank Schweizerischer Hypothekarinstitute AG, Zuerich, Schweiz												
	CHF	5'000.00	23.01.2012	23.01.2017	14 714 434		-	100.619	23.01.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	15.01.2013	17.03.2017	20 400 272		-	100.320	17.03.	0.250	12.500	N
	CHF	5'000.00	24.08.2011	24.05.2017	13 517 631		-	100.341	24.05.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	27.06.2006	27.06.2017	2 591 505		-	100.825	27.06.	3.000	150.00	N
	CHF	5'000.00	18.10.2010	18.10.2017	11 817 380		-	100.668	18.10.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	15.11.2005	15.11.2017	2 319 437		-	100.590	15.11.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	14.02.2013	19.01.2018	20 607 487	%	100.050	100.239	19.01.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	20.09.2012	15.03.2018	19 427 316	%	100.240	100.347	15.03.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	15.09.2010	22.05.2018	11 707 615	%	100.820	100.680	22.05.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	12.12.2012	13.07.2018	20 129 721	%	100.600	100.250	13.07.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	15.08.2006	15.08.2018	2 642 404	%	102.380	101.000	15.08.	3.125	156.25	N
	CHF	5'000.00	20.10.2005	19.10.2018	2 286 298	%	102.260	100.710	19.10.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	12.12.2007	12.12.2018	3 561 369	%	103.760	100.918	12.12.	3.250	162.50	N
	CHF	5'000.00	10.04.2015	25.01.2019	27 680 145	%	100.830	101.239	25.01.	0.125	6.250	N
	CHF	5'000.00	15.03.2007	15.03.2019	2 945 012	%	104.200	100.815	15.03.	2.875	143.75	N
	CHF	5'000.00	31.05.2012	15.03.2019	18 599 645	%	101.630	100.887	15.03.	0.750	37.500	N
	CHF	5'000.00	19.06.2013	15.04.2019	21 436 561	%	101.420	100.128	15.04.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	23.10.2012	17.06.2019	19 736 865	%	101.560	100.192	17.06.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	14.02.2012	13.08.2019	14 917 612	%	102.290	100.491	13.08.	0.875	43.750	N
	CHF	5'000.00	16.02.2011	27.09.2019	12 413 881	%	104.400	100.223	27.09.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	20.01.2010	30.10.2019	10 878 560	%	105.290	100.265	30.10.	2.375	118.75	N
	CHF	5'000.00	15.12.2005	13.12.2019	2 343 801	%	105.860	100.200	13.12.	2.500	125.00	N
	CHF	5'000.00	25.01.2016	09.01.2020	31 017 555	%	100.950	101.195	25.01.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	30.03.2010	25.02.2020	11 100 720	%	105.950	100.584	25.02.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	13.08.2010	13.05.2020	11 596 738	%	105.530	100.752	13.05.	1.875	93.750	N
	CHF	5'000.00	15.10.2015	06.07.2020	29 945 331	%	101.010	100.997	15.10.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	18.10.2010	03.08.2020	11 817 382	%	105.250	100.201	03.08.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	16.10.2006	16.10.2020	2 718 861	%	108.760	100.900	16.10.	2.750	137.50	N
	CHF	5'000.00	25.01.2011	25.11.2020	12 278 756	%	107.220	100.808	25.11.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	03.12.2015	25.11.2020	30 475 512	%	101.020	102.140	03.12.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	27.01.2006	27.01.2021	2 399 118	%	108.370	100.700	27.01.	2.375	118.75	N
	CHF	5'000.00	20.01.2014	03.03.2021	23 321 601	%	104.620	100.035	03.03.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	02.09.2016	26.03.2021	33 635 273	%	101.060	101.849	02.09.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	15.07.2013	10.05.2021	21 775 663	%	105.250	100.370	10.05.	1.250	62.500	N
	CHF	5'000.00	10.10.2014	02.07.2021	25 567 832	%	102.310	100.192	02.07.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	25.04.2016	02.07.2021	31 941 591	%	101.010	101.570	25.04.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	15.08.2012	13.08.2021	19 224 125	%	104.630	101.061	13.08.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	20.05.2014	05.10.2021	24 400 641	%	104.270	100.897	05.10.	0.875	43.750	N
	CHF	5'000.00	30.11.2011	30.11.2021	14 338 396	%	106.400	100.862	30.11.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	17.03.2014	14.01.2022	23 884 189	%	105.020	100.068	14.01.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	14.02.2007	14.02.2022	2 896 820	%	112.830	101.190	14.02.	2.875	143.75	N
	CHF	5'000.00	21.11.2016	14.02.2022	34 336 682	%	100.960	101.372	21.11.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	15.09.2011	15.03.2022	13 765 946	%	107.800	100.004	15.03.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	28.04.2014	10.05.2022	24 192 630	%	105.220	100.429	10.05.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	20.05.2016	05.07.2022	32 373 561	%	100.870	101.480	20.05.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	15.08.2013	15.08.2022	22 068 461	%	107.220	100.390	15.08.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	10.10.2007	10.10.2022	3 396 174	%	116.960	100.045	10.10.	3.375	168.75	N
	CHF	5'000.00	27.06.2017	22.11.2022	37 094 353	%	100.810	101.275	22.11.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	28.11.2013	16.01.2023	22 862 238	%	108.360	100.932	16.01.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	09.07.2014	21.03.2023	24 784 999	%	105.950	101.180	21.03.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	23.09.2016	16.05.2023	33 833 040	%	100.600	101.974	23.09.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	28.06.2010	28.06.2023	11 426 025	%	112.260	100.826	28.06.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	29.04.2013	29.09.2023	21 158 891	%	107.680	100.961	29.09.	1.250	62.500	N
	CHF	5'000.00	16.11.2012	16.11.2023	19 958 958	%	107.040	101.146	16.11.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	12.05.2015	04.12.2023	28 056 909	%	101.060	100.207	04.12.	0.125	6.250	N
	CHF	5'000.00	25.01.2011	25.01.2024	12 278 760	%	114.750	101.251	25.01.	2.375	118.75	N
	CHF	5'000.00	14.02.2012	14.02.2024	14 917 616	%	108.690	101.123	14.02.	1.375	68.750	N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	CHF	5'000.00	24.05.2017	25.03.2024	36 274 832	%	100.940	100.787		0.125	0.000	N
	CHF	5'000.00	29.07.2014	21.05.2024	24 908 813	%	106.590	100.260	21.05.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	10.11.2014	23.08.2024	25 858 638	%	105.000	100.411	23.08.	0.750	37.500	N
	CHF	5'000.00	31.03.2014	14.11.2024	23 984 012	%	109.360	100.015	14.11.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	19.06.2015	24.01.2025	28 468 740	%	103.330	100.186	24.01.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	19.12.2014	19.03.2025	26 422 701	%	104.140	100.772	19.03.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	23.01.2017	06.05.2025	34 755 690	%	100.480	100.599	06.05.	0.125	1.788	N
	CHF	5'000.00	27.06.2011	27.06.2025	13 217 605	%	117.260	101.442	27.06.	2.375	118.75	N
	CHF	5'000.00	15.07.2013	15.07.2025	21 775 665	%	112.680	100.828	15.07.	1.750	87.500	N
	CHF	5'000.00	28.09.2015	15.10.2025	29 713 234	%	102.180	100.479	15.10.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	28.04.2014	15.12.2025	24 192 631	%	111.010	100.855	15.12.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	13.08.2015	26.01.2026	29 162 523	%	102.070	100.267	26.01.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	30.03.2011	30.03.2026	12 651 904	%	119.520	100.785	30.03.	2.500	125.00	N
	CHF	5'000.00	12.12.2017	27.04.2026	39 288 573	%	101.220	101.075		0.250	0.000	N
	CHF	5'000.00	10.10.2014	07.07.2026	25 567 833	%	107.240	100.331	07.07.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	25.01.2016	05.08.2026	31 017 556	%	100.840	100.788	05.08.	0.250	12.500	N
	CHF	5'000.00	18.10.2017	18.09.2026	38 412 506	%	100.720	100.112		0.250	0.000	N
	CHF	5'000.00	27.06.2017	20.10.2026	37 094 354	%	100.750	101.140	20.10.	0.250	3.923	N
	CHF	5'000.00	29.04.2011	15.12.2026	12 889 110	%	122.920	101.533	15.12.	2.750	137.50	N
	CHF	5'000.00	13.04.2017	18.01.2027	36 017 276	%	100.610	101.013		0.250	0.000	N
	CHF	5'000.00	16.02.2011	16.02.2027	12 413 884	%	120.930	100.411	16.02.	2.500	125.00	N
	CHF	5'000.00	27.04.2012	27.04.2027	18 404 354	%	112.100	100.584	27.04.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	15.06.2007	15.06.2027	3 122 613	%	128.410	100.450	15.06.	3.250	162.50	N
	CHF	5'000.00	15.08.2012	13.08.2027	19 224 127	%	110.920	100.750	13.08.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	05.09.2017	12.10.2027	37 394 509	%	100.100	100.528	12.10.	0.250	1.284	N
	CHF	5'000.00	20.05.2016	15.12.2027	32 373 562	%	99.040	100.734	15.12.	0.125	6.250	N
	CHF	5'000.00	23.01.2012	21.01.2028	14 714 436	%	112.720	100.126	21.01.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	23.01.2017	21.03.2028	34 755 691	%	100.980	101.188	21.03.	0.375	3.020	N
	CHF	5'000.00	23.02.2015	05.05.2028	27 128 854	%	102.350	100.492	05.05.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	25.04.2016	06.09.2028	31 941 592	%	98.110	100.156	06.09.	0.125	6.250	N
	CHF	5'000.00	03.12.2010	01.12.2028	12 016 848	%	119.880	101.614	01.12.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	10.11.2015	15.06.2029	30 242 439	%	101.750	101.118	15.06.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	20.09.2012	20.09.2029	19 427 320	%	111.650	101.073	20.09.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	15.02.2017	21.12.2029	35 342 803	%	101.380	100.816	21.12.	0.500	21.250	N
	CHF	5'000.00	30.01.2015	21.01.2030	26 722 231	%	99.850	100.202	21.01.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	30.03.2010	27.03.2030	11 100 804	%	126.610	100.713	27.03.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	29.04.2013	03.07.2030	21 158 894	%	114.990	101.370	03.07.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	18.10.2017	18.10.2030	38 412 507	%	102.610	101.348		0.625	0.000	N
	CHF	5'000.00	16.02.2011	14.02.2031	12 433 893	%	127.960	101.497	14.02.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	28.08.2015	16.05.2031	29 302 622	%	102.340	100.271	16.05.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	02.09.2016	15.07.2031	33 635 274	%	95.700	100.797	15.07.	0.125	5.434	N
	CHF	5'000.00	15.09.2010	15.09.2031	11 707 637	%	118.800	101.431	15.09.	1.875	93.750	N
	CHF	5'000.00	25.04.2016	26.01.2032	31 941 593	%	98.580	101.729	26.01.	0.375	14.114	N
	CHF	5'000.00	19.06.2015	12.05.2032	28 468 741	%	107.210	101.621	12.05.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	13.08.2010	13.08.2032	11 596 739	%	124.670	100.515	13.08.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	23.09.2016	23.09.2032	33 833 041	%	94.730	101.083	23.09.	0.125	6.250	N
	CHF	5'000.00	10.10.2014	10.12.2032	25 567 834	%	112.410	100.024	10.12.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	10.04.2015	25.04.2033	27 680 147	%	101.540	100.167	25.04.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	02.08.2012	02.08.2033	19 036 937	%	114.410	102.086	02.08.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	28.11.2013	28.11.2033	22 862 239	%	124.100	101.466	28.11.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	12.05.2015	25.01.2034	28 056 913	%	101.190	101.975	25.01.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	03.12.2015	28.11.2034	30 475 515	%	103.090	101.808	28.11.	0.750	37.500	N
	CHF	5'000.00	24.05.2017	25.01.2035	36 274 834	%	100.800	100.890		0.625	0.000	N
	CHF	5'000.00	23.02.2015	07.05.2035	27 128 855	%	104.960	101.118	07.05.	0.875	43.750	N
	CHF	5'000.00	25.04.2016	05.10.2035	31 941 594	%	98.700	102.009	05.10.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	10.11.2014	09.11.2035	25 858 639	%	115.280	102.012	09.11.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	28.09.2015	25.01.2036	29 713 236	%	106.810	101.692	25.01.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	14.10.2016	14.10.2036	33 833 047	%	93.580	102.019	14.10.	0.250	12.500	N
	CHF	5'000.00	23.01.2017	23.01.2037	34 755 692	%	100.300	101.464		0.625	0.000	N
	CHF	5'000.00	29.05.2015	25.06.2037	28 252 889	%	104.430	100.824	25.06.	0.875	43.750	N
	CHF	5'000.00	04.08.2016	04.08.2038	33 093 883	%	92.390	101.900	04.08.	0.250	12.500	N
	CHF	5'000.00	18.10.2017	18.10.2038	38 412 508	%	102.100	100.408		0.750	0.000	N
	CHF	5'000.00	08.07.2016	08.07.2039	32 829 806	%	94.370	101.129	08.07.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	27.06.2017	18.10.2039	37 094 355	%	99.200	100.782	18.10.	0.625	9.635	N
	CHF	5'000.00	14.02.2012	14.02.2040	14 917 617	%	117.110	100.906	14.02.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	02.09.2016	17.05.2040	33 635 275	%	92.450	100.387	17.05.	0.250	8.854	N
	CHF	5'000.00	05.12.2014	05.12.2040	26 162 741	%	117.410	102.146	05.12.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	30.11.2011	29.11.2041	14 338 397	%	120.650	100.214	29.11.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	19.06.2015	19.06.2042	28 468 742	%	109.700	100.488	19.06.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	23.09.2016	23.09.2043	33 833 042	%	92.450	103.127	23.09.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	03.03.2014	03.03.2044	23 764 996	%	133.880	102.513	03.03.	2.125	106.25	N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	CHF	5'000.00	29.05.2015	25.01.2045	28 252 890	%	107.260	101.751	25.01.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	02.09.2016	15.06.2046	33 635 276	%	91.400	102.888	15.06.	0.375	14.739	N
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG, Zuerich, Schweiz												
	CHF	5'000.00	21.02.2011	21.02.2017	12 465 621		-	100.274	21.02.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	28.02.2007	28.02.2017	2 929 842		-	100.340	28.02.	2.750	137.50	N
	CHF	5'000.00	12.04.2010	12.04.2017	11 182 580		-	100.300	12.04.	1.750	87.500	N
	CHF	5'000.00	15.09.2008	15.09.2017	4 525 998		-	100.640	15.09.	3.125	156.25	N
	CHF	5'000.00	16.09.2009	15.09.2017	10 513 489		-	100.700	15.09.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	31.10.2013	31.10.2017	22 594 146		-	100.168	31.10.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	12.12.2013	01.12.2017	22 957 165		-	100.277	01.12.	0.250	12.500	N
	CHF	5'000.00	11.02.2010	09.02.2018	10 955 958	%	100.280	100.412	09.02.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	15.02.2008	15.02.2018	3 720 451	%	100.440	100.260	15.02.	3.000	150.00	N
	CHF	5'000.00	17.02.2014	28.03.2018	23 547 533	%	100.240	100.058	28.03.	0.250	12.500	N
	CHF	5'000.00	20.02.2013	02.05.2018	20 636 817	%	100.420	100.413	02.05.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	23.06.2008	21.06.2018	4 289 963	%	102.000	100.420	21.06.	3.500	175.00	N
	CHF	5'000.00	10.04.2014	21.06.2018	24 062 374	%	100.470	100.256	21.06.	0.250	12.500	N
	CHF	5'000.00	02.10.2006	02.10.2018	2 701 503	%	102.620	101.230	02.10.	2.750	137.50	N
	CHF	5'000.00	03.02.2012	03.12.2018	14 829 543	%	101.440	100.811	03.12.	0.875	43.750	N
	CHF	5'000.00	10.02.2009	08.02.2019	4 987 459	%	103.620	100.460	08.02.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	15.09.2014	15.05.2019	25 360 908	%	100.960	100.166	15.05.	0.125	6.250	N
	CHF	5'000.00	13.11.2012	15.07.2019	19 880 029	%	101.620	100.543	15.07.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	17.07.2014	15.07.2019	24 820 462	%	101.230	100.255	15.07.	0.250	12.500	N
	CHF	5'000.00	10.09.2007	10.09.2019	3 347 074	%	106.430	100.625	10.09.	3.250	162.50	N
	CHF	5'000.00	02.11.2009	01.11.2019	10 660 271	%	105.310	100.230	01.11.	2.375	118.75	N
	CHF	5'000.00	01.11.2010	01.11.2019	11 901 506	%	104.170	100.910	01.11.	1.750	87.500	N
	CHF	5'000.00	21.02.2011	21.02.2020	12 465 624	%	105.570	100.844	21.02.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	23.10.2014	21.02.2020	25 643 459	%	101.530	100.663	21.02.	0.250	12.500	N
	CHF	5'000.00	06.04.2011	06.04.2020	12 735 036	%	105.820	100.967	06.04.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	30.04.2014	06.04.2020	24 259 527	%	102.150	100.163	06.04.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	13.09.2013	12.06.2020	22 213 650	%	103.780	100.545	12.06.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	15.09.2015	15.07.2020	29 518 637	%	101.280	100.875	15.09.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	03.09.2010	03.09.2020	11 670 675	%	105.060	100.828	03.09.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	17.02.2014	17.02.2021	23 547 534	%	104.180	100.567	17.02.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	16.04.2013	16.04.2021	21 024 030	%	103.910	100.510	16.04.	0.875	43.750	N
	CHF	5'000.00	10.04.2014	10.06.2021	24 062 375	%	104.060	101.573	10.06.	0.875	43.750	N
	CHF	5'000.00	02.09.2011	02.09.2021	13 684 699	%	106.260	100.208	02.09.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	16.09.2009	16.09.2021	10 513 492	%	110.760	100.750	16.09.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	31.10.2013	29.10.2021	22 594 160	%	105.770	100.383	29.10.	1.250	62.500	N
	CHF	5'000.00	15.12.2011	15.12.2021	14 427 906	%	106.400	100.671	15.12.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	30.03.2016	15.12.2021	31 251 269	%	101.000	101.150	30.03.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	03.02.2012	03.02.2022	14 829 545	%	106.040	100.906	03.02.	1.250	62.500	N
	CHF	5'000.00	11.02.2010	11.02.2022	10 955 959	%	111.240	100.964	11.02.	2.500	125.00	N
	CHF	5'000.00	25.07.2013	22.04.2022	21 851 787	%	106.810	100.964	22.04.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	20.12.2012	20.06.2022	20 159 170	%	105.000	100.876	20.06.	0.875	43.750	N
	CHF	5'000.00	10.09.2012	09.09.2022	19 371 754	%	105.560	100.722	09.09.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	07.06.2016	07.11.2022	31 940 373	%	100.710	101.358	07.06.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	12.12.2013	12.12.2022	22 957 177	%	107.540	101.025	12.12.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	13.11.2012	13.02.2023	19 880 032	%	105.780	100.934	13.02.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	30.04.2014	28.04.2023	24 259 614	%	106.590	100.973	28.04.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	17.06.2011	16.06.2023	13 161 074	%	112.870	100.575	16.06.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	15.12.2015	25.07.2023	30 617 372	%	100.460	100.000	15.12.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	30.06.2015	30.08.2023	28 584 935	%	102.550	100.918	30.08.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	22.12.2014	20.10.2023	26 343 297	%	103.640	100.339	20.10.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	17.07.2014	18.12.2023	24 820 964	%	106.280	100.828	18.12.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	12.04.2017	05.02.2024	35 767 615	%	100.370	100.000		0.010	0.000	N
	CHF	5'000.00	30.04.2015	12.03.2024	27 866 710	%	101.150	100.129	12.03.	0.125	6.250	N
	CHF	5'000.00	15.09.2014	15.04.2024	25 360 923	%	104.860	100.378	15.04.	0.750	37.500	N
	CHF	5'000.00	02.09.2016	14.06.2024	33 658 766	%	100.120	101.097	02.09.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	17.07.2012	17.07.2024	18 906 973	%	108.290	101.259	17.07.	1.250	62.500	N
	CHF	5'000.00	02.11.2015	17.07.2024	30 087 426	%	100.870	100.114	17.07.	0.125	6.250	N
	CHF	5'000.00	23.10.2014	23.09.2024	25 643 460	%	105.020	100.185	23.09.	0.750	37.500	N
	CHF	5'000.00	31.10.2011	31.10.2024	14 121 969	%	111.040	100.759	31.10.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	28.11.2016	02.12.2024	34 458 380	%	100.710	100.212	02.12.	0.125	6.319	N
	CHF	5'000.00	16.03.2015	14.02.2025	27 348 538	%	102.450	101.676	14.02.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	16.04.2013	16.04.2025	21 024 031	%	109.670	101.259	16.04.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	15.12.2016	21.05.2025	34 458 379	%	101.390	100.846	21.05.	0.250	5.416	N
	CHF	5'000.00	28.07.2015	28.07.2025	28 828 638	%	103.180	100.586	28.07.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	15.09.2015	15.09.2025	29 518 638	%	102.220	100.664	15.09.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	01.11.2010	30.10.2025	11 901 508	%	114.950	100.030	30.10.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	17.07.2017	01.12.2025	36 153 306	%	101.130	100.664	01.12.	0.250	4.652	N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	CHF	5'000.00	25.07.2013	25.02.2026	21 851 789	%	113.290	101.328	25.02.	1.750	87.500	N
	CHF	5'000.00	15.12.2015	25.02.2026	30 617 373	%	100.020	100.248	25.02.	0.125	6.250	N
	CHF	5'000.00	06.04.2011	06.04.2026	12 735 037	%	118.400	100.191	06.04.	2.375	118.75	N
	CHF	5'000.00	06.06.2017	12.05.2026	36 153 291	%	100.920	101.028		0.250	0.000	N
	CHF	5'000.00	17.02.2014	17.06.2026	23 547 535	%	112.420	100.049	17.06.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	02.09.2011	02.09.2026	13 684 715	%	113.580	101.466	02.09.	1.750	87.500	N
	CHF	5'000.00	21.10.2016	02.10.2026	33 764 558	%	98.690	100.000	21.10.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	07.06.2016	06.11.2026	31 940 374	%	98.930	100.416	06.11.	0.050	2.500	N
	CHF	1'000.00	12.04.2017	07.12.2026	35 767 616	%	101.710	100.969	07.12.	0.375	2.447	N
	CHF	5'000.00	02.09.2016	27.01.2027	33 658 771	%	98.330	100.209	02.09.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	19.03.2012	19.03.2027	18 121 502	%	110.850	100.204	19.03.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	04.05.2017	26.05.2027	36 153 282	%	100.270	100.684	26.05.	0.250	0.76388	N
	CHF	5'000.00	30.06.2015	30.06.2027	28 584 936	%	103.950	100.115	30.06.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	21.02.2017	21.09.2027	35 259 588	%	101.350	100.902	21.09.	0.375	10.937	N
	CHF	5'000.00	05.02.2013	05.11.2027	20 456 725	%	110.960	100.720	05.11.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	01.12.2017	06.12.2027	37 347 619	%	100.000	100.040		0.250	0.000	N
	CHF	5'000.00	11.02.2016	11.02.2028	30 725 642	%	99.720	100.089	11.02.	0.250	12.500	N
	CHF	5'000.00	17.04.2012	17.04.2028	18 291 088	%	113.590	101.854	17.04.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	21.06.2013	21.06.2028	21 506 435	%	112.620	101.075	21.06.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	31.10.2017	24.07.2028	37 347 607	%	100.830	100.652		0.375	0.000	N
	CHF	5'000.00	22.12.2014	22.09.2028	26 343 298	%	107.540	101.521	22.09.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	28.11.2016	24.10.2028	34 458 381	%	100.710	100.325	24.10.	0.375	16.979	N
	CHF	5'000.00	20.06.2014	05.02.2029	24 586 398	%	112.860	100.363	05.02.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	21.05.2012	21.05.2029	18 525 822	%	113.420	101.416	21.05.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	16.03.2015	16.07.2029	27 348 539	%	103.020	101.940	16.07.	0.625	31.250	N
	CHF	1'000.00	12.04.2017	12.10.2029	35 767 617	%	101.460	100.682	12.10.	0.500	2.500	N
	CHF	5'000.00	18.11.2014	16.11.2029	25 981 058	%	110.100	101.802	16.11.	1.250	62.500	N
	CHF	5'000.00	12.02.2015	12.02.2030	26 878 698	%	102.760	102.495	12.02.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	30.04.2015	30.04.2030	27 866 711	%	101.150	101.490	30.04.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	15.12.2015	20.09.2030	30 617 374	%	101.400	100.917	20.09.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	02.11.2015	01.11.2030	30 087 428	%	102.570	100.181	01.11.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	07.06.2016	06.06.2031	31 940 378	%	98.580	100.626	06.06.	0.300	14.958	N
	CHF	5'000.00	02.09.2016	02.09.2031	33 658 772	%	95.520	101.158	02.09.	0.125	6.250	N
	CHF	5'000.00	21.02.2017	20.02.2032	35 259 589	%	100.330	100.110		0.500	0.000	N
	CHF	5'000.00	30.03.2016	30.03.2034	31 251 271	%	99.210	101.576	30.03.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	11.02.2016	11.12.2035	30 725 645	%	100.060	100.334	11.12.	0.600	30.000	N
Proman Holding Ltd, Wollerau, Schweiz												
	CHF	5'000.00	31.05.2017	31.05.2022	36 274 836	%	99.900	100.000		3.500	0.000	N
PSP Swiss Property AG, Zug, Schweiz												
	CHF	5'000.00	08.02.2013	08.02.2019	19 677 045	%	101.360	100.493	08.02.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	04.02.2014	04.02.2020	22 988 113	%	103.200	100.464	04.02.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	16.02.2016	16.02.2024	30 725 643	%	101.750	100.313	16.02.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	06.02.2015	06.02.2025	26 288 145	%	105.350	100.190	06.02.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	29.04.2016	29.04.2026	31 940 377	%	102.050	100.172	29.04.	0.375	18.750	N
Psychiatrische Dienste Aargau AG, Windisch, Schweiz												
	CHF	5'000.00	10.10.2014	10.10.2022	25 543 975	%	103.050	100.576	10.10.	0.750	37.500	N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF		IUP
Raiffeisen Schweiz Genossenschaft, St. Gallen, Schweiz													
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG	CHF	5'000.00	02.05.2013		21 063 849	%	100.700	101.000	02.05.	VAR.	105.00	(L)	N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG	CHF	5'000.00	02.04.2015		27 274 875	%	104.000	100.000	02.10.	2.000	100.00	(L)	N
	CHF	5'000.00	07.02.2014	07.02.2017	23 322 620		-	100.000	07.02.	VAR.	0.000		N
	CHF	5'000.00	21.09.2010	21.09.2017	11 671 263		-	100.255	21.09.	1.375	68.750		N
	CHF	5'000.00	10.05.2011	10.05.2018	12 870 521	%	101.040	100.686	10.05.	2.375	118.75		N
	CHF	5'000.00	04.02.2011	04.02.2019	12 251 214	%	102.730	100.969	04.02.	2.125	106.25		N
	CHF	5'000.00	21.12.2011	21.12.2021	14 370 887	%	113.650	100.945	21.12.	3.875	193.75		N
	CHF	5'000.00	07.02.2014	07.02.2022	23 322 621	%	106.450	100.924	07.02.	1.625	81.250		N
	CHF	5'000.00	21.09.2010	21.09.2023	11 671 264	%	110.900	100.803	21.09.	2.000	100.00		N
Tranche 1	CHF	5'000.00	22.04.2016	22.04.2025	32 071 259	%	100.250	100.000	22.04.	0.300	15.000		N
	CHF	5'000.00	04.02.2011	04.02.2026	12 251 215	%	118.250	101.104	04.02.	2.625	131.25		N
Tranche 2	CHF	5'000.00	22.04.2016	22.04.2031	32 071 260	%	100.250	100.000	22.04.	0.750	37.500		N
Regionalspital Emmental AG, Burgdorf, Schweiz													
	CHF	5'000.00	17.04.2014	17.04.2023	24 088 470	%	107.350	100.110	17.04.	1.625	81.250		N
Repower AG, Brusio, Schweiz													
	CHF	5'000.00	20.07.2010	20.07.2022	10 915 272	%	105.500	100.000	20.07.	2.375	118.75		N
Rieter Holding AG, Winterthur, Schweiz													
	CHF	5'000.00	29.09.2014	29.09.2020	25 351 477	%	102.900	100.215	29.09.	1.500	75.000		N
Roche Kapitalmarkt AG, Basel, Schweiz													
	CHF	5'000.00	23.03.2009	23.03.2017	3 913 926		-	100.313	23.03.	4.500	225.00		N
	CHF	5'000.00	23.03.2012	21.09.2018	18 051 306	%	101.210	100.485	21.09.	1.000	50.000		N
Tranche 1	CHF	5'000.00	23.03.2017	23.09.2018	35 865 496	%	100.500	100.755	23.09.	0.000	0.000		N
	CHF	5'000.00	23.03.2012	23.09.2022	18 051 318	%	108.100	100.844	23.09.	1.625	81.250		N
Tranche 2	CHF	5'000.00	23.03.2017	23.09.2024	35 865 497	%	100.400	100.168	23.09.	0.100	2.500		N
Tranche 3	CHF	5'000.00	23.03.2017	23.03.2029	35 991 540	%	100.300	100.175		0.450	0.000		N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Schaffhauser Kantonalbank, Schaffhausen, Schweiz												
	CHF	5'000.00	24.04.2013	24.04.2023	21 046 131	%	106.400	100.750	24.04.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	28.10.2013	28.10.2025	22 492 351	%	112.350	101.127	28.10.	1.750	87.500	N
	CHF	5'000.00	16.02.2015	16.02.2027	26 969 793	%	101.050	100.235	16.02.	0.375	18.750	N
Schweizerische Eidgenossenschaft, Bern, Schweiz												
Steuerlich relevanter Emissionspreis 105.06122826% (ermittelt aufgrund der volumengewichteten Emissionspreise der Grundanleihe und der Aufstockungen)	CHF	1'000.00	05.06.1997	05.06.2017	644 842		-	105.061	05.06.	4.250	42.500	N
	CHF	1'000.00	08.01.2003	08.01.2018	1 522 166	%	100.040	102.637	08.01.	3.000	30.000	N
	CHF	1'000.00	12.05.2004	12.05.2019	1 845 425	%	105.390	99.250	12.05.	3.000	30.000	N
	CHF	1'000.00	06.07.2005	06.07.2020	2 190 890	%	107.660	100.500	06.07.	2.250	22.500	N
	CHF	1'000.00	28.04.2010	28.04.2021	11 199 981	%	108.960	100.000	28.04.	2.000	20.000	N
	CHF	1'000.00	25.05.2011	25.05.2022	12 718 101	%	111.280	100.100	25.05.	2.000	20.000	N
	CHF	1'000.00	11.02.1998	11.02.2023	843 556	%	123.410	99.750	11.02.	4.000	40.000	N
	CHF	1'000.00	11.06.2012	11.06.2024	12 718 117	%	110.860	105.500	11.06.	1.250	12.500	N
	CHF	1'000.00	24.07.2013	24.07.2025	18 424 999	%	114.000	102.500	24.07.	1.500	15.000	N
	CHF	1'000.00	28.05.2014	28.05.2026	22 439 698	%	113.030	103.300	28.05.	1.250	12.500	N
	CHF	1'000.00	27.06.2007	27.06.2027	3 183 556	%	132.610	97.500	27.06.	3.250	32.500	N
	CHF	1'000.00	08.04.1998	08.04.2028	868 037	%	142.500	97.750	08.04.	4.000	40.000	N
	CHF	1'000.00	22.06.2016	22.06.2029	22 439 734	%	100.580	103.000	22.06.	0.000	0.000	N
	CHF	1'000.00	27.05.2015	27.05.2030	22 439 717	%	106.150	105.250	27.05.	0.500	5.000	N
	CHF	1'000.00	22.06.2011	22.06.2031	12 718 102	%	129.250	100.000	22.06.	2.250	22.500	N
	CHF	1'000.00	08.04.2003	08.04.2033	1 580 323	%	150.450	95.000	08.04.	3.500	35.000	N
	CHF	1'000.00	08.03.2006	08.03.2036	2 452 496	%	140.250	102.100	08.03.	2.500	25.000	N
	CHF	1'000.00	27.06.2012	27.06.2037	12 718 119	%	118.850	107.250	27.06.	1.250	12.500	N
	CHF	1'000.00	30.04.2012	30.04.2042	12 718 116	%	128.050	108.350	30.04.	1.500	15.000	N
	CHF	1'000.00	28.06.2017	28.06.2045	34 495 849	%	104.600	106.500		0.500	0.000	N
	CHF	1'000.00	06.01.1999	06.01.2049	975 519	%	205.800	98.000	06.01.	4.000	40.000	N
	CHF	1'000.00	24.05.2017	24.05.2055	34 495 847	%	104.120	104.750		0.500	0.000	N
	CHF	1'000.00	30.05.2016	30.05.2058	22 439 733	%	103.590	110.000	30.05.	0.500	5.000	N
Schweizerische Rueckversicherungs-Gesellschaft AG, Zürich, Schweiz	CHF	1'000.00	25.06.2014	25.06.2064	22 439 700	%	164.500	155.000	25.06.	2.000	20.000	N
1.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	09.02.2012	12.09.2017	14 213 204		-	101.000	01.09.	7.250	362.50	N
	CHF	5'000.00	22.12.2011	22.09.2017	14 493 431		-	100.612	22.09.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	17.09.2014	17.09.2024	24 948 368	%	105.800	100.487	17.09.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	21.01.2015	21.01.2027	26 288 144	%	103.850	100.660	21.01.	0.750	37.500	N
	CHF	100'000.00	07.10.2013	01.09.2045	22 479 897	%	110.750	101.000	01.09.	7.500	7'500.00	N
Schwyzer Kantonalbank, Schwyz, Schweiz												
	CHF	5'000.00	10.02.2011	10.02.2017	12 248 449		-	100.369	10.02.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	12.03.2014	12.03.2020	23 765 081	%	102.650	100.778	12.03.	0.750	37.500	N
	CHF	5'000.00	05.10.2012	05.10.2020	19 435 227	%	102.950	100.748	05.10.	0.750	37.500	N
	CHF	5'000.00	24.09.2013	24.09.2021	22 276 082	%	105.850	100.556	24.09.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	20.02.2013	20.02.2023	20 531 090	%	106.000	101.200	20.02.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	02.07.2015	02.07.2025	28 491 589	%	103.600	100.825	02.07.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	19.02.2016	19.02.2026	31 313 006	%	100.450	100.520	19.02.	0.250	12.500	N
	CHF	5'000.00	04.03.2015	04.03.2027	27 001 783	%	99.750	100.000	04.03.	0.250	12.500	N
	CHF	5'000.00	25.10.2016	25.10.2028	34 090 792	%	97.050	100.000	25.10.	0.100	5.000	N
Services Industriels de Geneve, Vernier, Schweiz												
	CHF	5'000.00	30.06.2015	30.06.2025	28 201 900	%	105.900	100.869	30.06.	1.250	62.500	N
SGS SA, Genève, Schweiz												
	CHF	5'000.00	08.03.2011	08.03.2019	12 485 360	%	103.560	100.832	08.03.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	27.05.2011	27.05.2021	13 003 656	%	110.450	100.480	27.05.	3.000	150.00	N
	CHF	1'000.00	27.02.2014	25.02.2022	23 612 272	%	105.850	100.517	25.02.	1.375	13.750	N
	CHF	5'000.00	08.05.2015	08.05.2023	27 913 531	%	101.000	100.079	08.05.	0.250	12.500	N
	CHF	5'000.00	27.02.2014	27.02.2024	23 612 274	%	109.650	101.019	27.02.	1.750	87.500	N
	CHF	5'000.00	03.03.2017	03.03.2026	35 259 592	%	101.850	100.153		0.550	0.000	N
	CHF	5'000.00	08.05.2015	08.05.2030	27 913 532	%	102.650	100.245	08.05.	0.875	43.750	N
Siegfried Holding AG, Zofingen, Schweiz												
	CHF	5'000.00	26.10.2015		29 734 357	%	104.350	100.000	26.10.	3.500	175.00	N
	CHF	5'000.00	26.10.2016		34 067 783	%	101.550	100.000	26.10.	2.125	106.25	N
Sika AG, Baar, Schweiz												
	CHF	5'000.00	12.07.2012	12.07.2018	18 616 399	%	100.810	100.442	12.07.	1.000	50.000	N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	CHF	5'000.00	14.11.2013	14.11.2019	22 476 150	%	102.600	100.500	14.11.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	12.07.2012	12.07.2022	18 616 400	%	107.350	100.928	12.07.	1.750	87.500	N
	CHF	5'000.00	14.11.2013	14.11.2023	22 476 151	%	109.600	100.452	14.11.	1.875	93.750	N
Sonova Holding AG, Stäfa, Schweiz												
	CHF	5'000.00	11.10.2016	11.10.2018	34 091 213	%	100.210	100.400	11.01. 11.04. 11.07. 11.10.	VAR.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
	CHF	5'000.00	11.10.2016	11.10.2019	34 091 214	%	100.650	100.150	11.10.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	11.10.2016	11.10.2021	34 091 215	%	100.100	100.000	11.10.	0.010	0.500	N
Spitalverband Limmattal, Schlieren, Schweiz												
	CHF	5'000.00	29.11.2013	29.11.2023	22 769 457	%	112.150	100.577	29.11.	1.875	93.750	N
	CHF	5'000.00	15.05.2015	15.05.2025	27 658 109	%	103.200	100.365	15.05.	0.550	27.500	N
St. Gallen (Stadt), Schweiz												
	CHF	5'000.00	10.11.2011	10.11.2025	14 081 984	%	111.950	100.667	10.11.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	21.09.2017	21.09.2037	38 001 157	%	99.400	100.897		0.600	0.000	N
St. Galler Kantonalbank AG, St. Gallen, Schweiz												
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG	CHF	5'000.00	30.11.2017		37 347 611	%	100.150	100.000		0.985	0.000	N
	CHF	5'000.00	27.07.2007	27.07.2017	3 190 106		-	101.500	27.07.	3.500	175.00	N
	CHF	5'000.00	30.11.2005	30.11.2017	2 329 813		-	100.600	30.11.	2.500	125.00	N
	CHF	5'000.00	12.12.2006	12.12.2018	2 797 213	%	102.960	100.550	12.12.	2.500	125.00	N
	CHF	5'000.00	16.12.2011	16.12.2019	14 213 202	%	104.050	100.436	16.12.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	11.05.2010	11.05.2020	11 240 387	%	106.500	100.720	11.05.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	28.01.2015	28.01.2021	26 615 365	%	101.800	100.770	28.01.	0.250	12.500	N
	CHF	5'000.00	30.06.2011	30.06.2021	13 072 051	%	107.900	100.793	30.06.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	09.09.2014	09.09.2022	25 274 025	%	103.500	100.305	09.09.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	13.09.2013	13.09.2022	22 173 204	%	107.650	100.210	13.09.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	24.06.2015	24.06.2025	28 408 758	%	102.750	100.316	24.06.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	22.06.2012	22.06.2027	18 704 382	%	110.100	100.770	22.06.	1.375	68.750	N
30.11.2017/30.11.2027 ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG	CHF	5'000.00	30.11.2017	30.11.2027	37 347 612	%	100.800	100.451		1.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	12.02.2013	12.02.2031	20 479 075	%	112.650	100.490	12.02.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	23.01.2017	23.01.2032	35 241 961	%	101.000	101.547		0.625	0.000	N
	CHF	5'000.00	27.12.2010	27.12.2040	12 084 789	%	129.400	100.270	27.12.	2.125	106.25	N
Stadt Winterthur, Winterthur, Schweiz												
	CHF	5'000.00	15.02.2006	15.02.2018	2 424 755	%	100.350	101.060	15.02.	2.375	118.75	N
	CHF	5'000.00	27.03.2015	27.03.2023	27 376 135	%	101.000	100.139	27.03.	0.150	7.500	N
	CHF	5'000.00	17.03.2017	17.03.2026	35 748 319	%	98.850	100.292		0.050	0.000	N
	CHF	5'000.00	10.12.2015	10.12.2027	30 576 577	%	99.800	100.059	10.12.	0.300	15.000	N
	CHF	5'000.00	06.06.2014	06.06.2029	24 497 506	%	112.200	100.630	06.06.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	28.01.2010	28.01.2030	10 949 769	%	127.100	100.020	28.01.	2.750	137.50	N
	CHF	5'000.00	24.01.2013	24.01.2036	20 427 621	%	114.300	100.747	24.01.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	20.04.2012	20.04.2037	18 233 733	%	121.700	101.487	20.04.	1.875	93.750	N
	CHF	5'000.00	10.02.2014	10.02.2039	22 988 115	%	129.550	100.666	10.02.	2.250	112.50	N
Straumann Holding AG, Basel, Schweiz												
	CHF	5'000.00	30.04.2013	30.04.2020	20 527 668	%	103.350	100.650	30.04.	1.625	81.250	N
Sulzer AG, Winterthur, Schweiz												
	CHF	5'000.00	11.07.2016	11.07.2022	32 637 145	%	100.900	100.371	11.07.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	11.07.2016	10.07.2026	32 637 146	%	102.300	100.169	11.07.	0.875	43.750	N
Swiss Auto Lease 2015-1 GmbH, Zürich, Schweiz												
	CHF	5'000.00	23.03.2015	25.03.2019	27 375 582	%	100.610	100.000	23.03.	0.230	11.500	N
Swiss Auto Lease 2016-1 GmbH, Zürich, Schweiz												
	CHF	5'000.00	23.06.2016	23.03.2020	32 829 802	%	100.700	100.000	23.06.	0.220	11.000	N
Swiss Car ABS 2015-1 Ltd, Baden, Schweiz												
	CHF	100'000.00	03.12.2015	19.11.2018	30 405 580	%	100.400	100.000	18.11.	0.200	200.00	N
Swiss Car ABS 2016-1 Ltd., Baden, Schweiz												
	CHF	100'000.00	04.05.2016	18.04.2018	31 940 308	%	100.150	100.000	18.04.	0.150	143.33	N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Swiss Car ABS 2016-2 Ltd., Baden, Schweiz												
	CHF	100'000.00	04.05.2016	18.04.2020	32 344 010	%	100.750	100.000	18.04.	0.300	286.66	N
Swiss Credit Card Issuance 2015-1 Ltd., Horgen, Schweiz												
	CHF	100'000.00	15.06.2015	15.06.2018	28 285 790	%	99.750	100.000	15.06.	1.125	1'125.00	N
	CHF	5'000.00	15.06.2015	15.06.2018	28 285 789	%	100.270	100.000	15.06.	0.180	9.000	N
	CHF	100'000.00	15.06.2015	15.06.2018	28 285 791	%	100.060	100.000	15.06.	1.875	1'875.00	N
Swiss Credit Card Issuance 2015-2 Ltd., Horgen, Schweiz												
	CHF	100'000.00	15.06.2015	15.06.2020	28 285 794	%	100.800	100.000	15.06.	2.375	2'375.00	N
	CHF	100'000.00	15.06.2015	15.06.2020	28 285 793	%	99.750	100.000	15.06.	1.500	1'500.00	N
	CHF	5'000.00	15.06.2015	15.06.2020	28 285 792	%	100.950	100.000	15.06.	0.340	17.000	N
Swiss Credit Card Issuance 2016-1 AG, Horgen, Schweiz												
	CHF	5'000.00	15.06.2016	15.06.2019	32 637 138	%	100.500	100.000	15.06.	0.130	6.500	N
Swiss Life AG, Zürich, Schweiz												
	CHF	5'000.00	22.10.2012		19 469 519	%	103.250	101.000	22.08.	5.500	275.00	N
	CHF	5'000.00	24.03.2016		31 699 464	%	107.800	100.000	24.09.	3.750	187.50	N
Tranche 2 Reg S	CHF	5'000.00	24.03.2016	24.09.2046	31 699 465	%	118.250	100.000	24.09.	4.375	218.75	N
Swiss Life Holding AG, Zürich, Schweiz												
	CHF	5'000.00	21.06.2013	21.06.2019	21 218 406	%	102.000	100.111	21.06.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	21.06.2013	21.06.2023	21 218 407	%	108.950	100.337	21.06.	1.875	93.750	N
Swiss Prime Site AG, Olten, Schweiz												
	CHF	5'000.00	11.07.2013	11.07.2018	21 564 566	%	100.800	100.366	11.07.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	10.12.2014	10.12.2019	25 704 216	%	102.450	100.159	10.12.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	21.10.2013	21.10.2020	21 565 073	%	105.250	100.626	21.10.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	16.04.2014	16.04.2021	23 427 449	%	105.350	100.268	16.04.	1.750	87.500	N
	CHF	5'000.00	10.12.2014	10.12.2024	25 704 217	%	109.500	100.202	10.12.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	03.11.2016	03.11.2025	33 764 553	%	99.700	100.418	03.11.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	11.05.2017	11.05.2026	36 067 729	%	100.800	100.000		0.825	0.000	N
Swisscom AG, Ittigen, Schweiz												
	CHF	5'000.00	19.07.2007	19.07.2017	3 225 473		-	100.930	19.07.	3.750	187.50	N
	CHF	5'000.00	14.09.2009	14.09.2018	10 469 162	%	102.750	100.638	14.09.	3.250	162.50	N
	CHF	5'000.00	31.08.2010	31.08.2022	11 469 537	%	112.400	100.593	31.08.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	17.04.2015	17.04.2023	26 898 817	%	101.200	100.277	17.04.	0.250	12.500	N
	CHF	5'000.00	10.07.2012	10.07.2024	18 833 536	%	111.100	100.832	10.07.	1.750	87.500	N
	CHF	5'000.00	14.07.2014	14.07.2026	24 777 613	%	110.450	101.437	14.07.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	31.05.2017	31.05.2027	36 274 835	%	101.300	100.196		0.375	0.000	N
	CHF	5'000.00	15.12.2016	15.12.2027	34 458 378	%	100.950	100.108	15.12.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	31.03.2016	31.03.2028	31 792 166	%	99.500	101.208	31.03.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	30.09.2014	28.09.2029	25 414 750	%	111.100	101.724	28.09.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	15.09.2016	15.09.2032	33 635 277	%	92.400	100.000	15.09.	0.125	6.250	N
	CHF	5'000.00	24.11.2017	24.11.2033	37 347 616	%	100.200	100.868		0.750	0.000	N
	CHF	5'000.00	17.04.2015	17.04.2035	26 898 818	%	103.300	101.044	17.04.	1.000	50.000	N
Swissgrid AG, Laufenburg, Schweiz												
	CHF	5'000.00	30.01.2013	30.01.2020	20 481 107	%	102.850	100.649	30.01.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	30.01.2013	30.01.2025	20 481 110	%	110.800	100.211	30.01.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	25.02.2015	25.02.2030	26 938 208	%	101.350	101.294	25.02.	0.625	31.250	N
Syngenta Finance Ltd, Basel, Schweiz												
	CHF	5'000.00	07.04.2014	01.11.2019	24 067 219	%	100.000	100.692	01.11.	0.750	37.500	N
	CHF	5'000.00	07.04.2014	01.11.2024	24 067 222	%	95.600	100.622	01.11.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	07.04.2014	01.11.2029	24 067 223	%	93.600	100.996	01.11.	2.125	106.25	N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Temenos Group AG, Genève, Schweiz												
	CHF	5'000.00	25.04.2013	25.07.2017	21 037 119		-	100.970	25.07.	2.750	137.50	N
	CHF	5'000.00	31.03.2014	31.01.2019	24 065 673	%	101.660	100.350	31.01.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	17.06.2015	17.06.2022	28 410 056	%	104.550	100.000	17.06.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	05.04.2017	05.04.2024	36 017 273	%	102.600	100.000		1.750	0.000	N
Thurgauer Kantonalbank, Weinfelden, Schweiz												
	CHF	5'000.00	15.09.2010	15.09.2017	11 649 221		-	100.300	15.09.	1.250	62.500	N
	CHF	5'000.00	23.10.2014	23.10.2020	25 589 619	%	101.900	100.515	23.10.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	25.02.2011	25.02.2021	12 413 100	%	107.850	100.940	25.02.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	30.11.2012	30.11.2022	19 832 348	%	105.600	100.994	30.11.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	28.02.2014	28.08.2023	23 668 684	%	108.200	100.668	28.08.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	30.09.2013	30.09.2024	22 226 149	%	111.250	100.749	30.09.	1.750	87.500	N
	CHF	5'000.00	31.03.2015	31.03.2025	27 535 212	%	101.950	100.098	31.03.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	04.03.2013	04.03.2027	20 699 227	%	111.300	100.343	04.03.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	08.02.2017	08.02.2028	35 310 519	%	100.450	100.215		0.375	0.000	N
	CHF	1'000.00	16.02.2015	16.02.2029	26 979 621	%	100.400	100.983	16.02.	0.500	5.000	N
	CHF	5'000.00	20.05.2016	20.05.2031	32 360 418	%	98.100	100.401	20.05.	0.375	18.750	N
Ticino (Cantone del), Bellinzona, Schweiz												
	CHF	5'000.00	09.02.2005	09.02.2017	2 043 148		-	100.970	09.02.	2.500	125.00	N
	CHF	5'000.00	18.02.2014	18.05.2018	23 483 547	%	100.400	100.542	18.05.	0.320	16.000	N
	CHF	5'000.00	21.11.2013	21.03.2019	22 686 905	%	101.380	100.510	21.03.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	11.06.2012	11.06.2020	18 193 294	%	102.900	100.457	11.06.	0.750	37.500	N
	CHF	5'000.00	13.10.2009	04.11.2021	10 316 501	%	110.650	100.239	04.11.	2.500	125.00	N
	CHF	5'000.00	09.09.2014	09.05.2022	25 142 938	%	103.600	101.055	09.05.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	21.11.2013	21.11.2022	22 686 906	%	107.500	101.066	21.11.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	13.11.2014	13.11.2024	25 775 456	%	105.050	100.678	13.11.	0.750	37.500	N
	CHF	5'000.00	06.03.2015	06.03.2025	26 683 614	%	100.850	100.323	06.03.	0.125	6.250	N
	CHF	5'000.00	22.12.2017	22.12.2025	38 787 907	%	99.500	100.060		0.010	0.000	N
	CHF	5'000.00	11.06.2012	11.06.2027	18 193 295	%	109.750	100.435	11.06.	1.250	62.500	N
	CHF	5'000.00	24.11.2010	24.11.2034	11 946 836	%	125.100	100.515	24.11.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	18.03.2013	18.03.2038	20 741 318	%	123.650	101.820	18.03.	1.875	93.750	N
	CHF	5'000.00	15.05.2013	15.05.2043	21 211 465	%	125.650	100.000	15.05.	1.800	90.000	N
	CHF	5'000.00	27.06.2016	27.06.2044	32 890 110	%	91.900	100.000	27.06.	0.400	20.000	N
Transports publics genevois (TPG), Lancy, Schweiz												
	CHF	5'000.00	21.05.2015	21.05.2035	28 006 349	%	105.400	100.000	21.05.	0.900	44.875	N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF		IUP
u-blox Holding AG, Thalwil, Schweiz													
	CHF	5'000.00	27.04.2015	27.04.2021	27 744 205	%	103.800	100.000	27.04.	1.625	81.250		N
	CHF	5'000.00	18.04.2017	18.04.2023	36 017 274	%	101.850	100.000		1.375	0.000		N
UBS AG, Zürich und Basel, Schweiz													
	CHF	5'000.00	27.12.2007	27.12.2017	3 578 921		-	100.434	27.12.	4.125	206.25		N
	USD	1'000.00	22.05.2013	22.05.2023	21 413 993	%	100.910	100.000	22.05.	4.750	46.203	(L)	N
22.5.2013/22.5.2023 ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG													
	USD	1'000.00	15.05.2014	15.05.2024	24 410 026	%	104.850	99.905	15.05.	5.125	51.077	(L)	N
15.4.2014/15.5.2024 ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG													
UBS Group AG, Zürich und Basel, Schweiz													
	USD	1'000.00	19.02.2015		27 142 833	%	113.370	100.000	19.02.	4.284	42.932	(L)	N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG													
	USD	1'000.00	19.02.2015		27 142 831	%	106.180	100.000	19.02.	3.861	38.693	(L)	N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG													
	EUR	1'000.00	19.02.2015		27 142 830	%	113.730	100.000	19.02.	3.013	32.070	(L)	N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG													
	USD	1'000.00	07.08.2015		28 686 402	%	110.710	100.000	07.08.	3.635	35.346	(L)	N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG													
	USD	1'000.00	21.03.2016		31 792 169	%	106.890	100.000	22.03.	3.629	35.920	(L)	N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG													
	USD	1'000.00	10.08.2016		33 145 531	%	108.670	100.000	10.08.	3.719	35.847	(L)	N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG													
UBS Group Funding (Switzerland) AG, Zürich, Schweiz													
	USD	1'000.00	05.04.2016	14.04.2021	32 072 226	%	103.590	100.000	17.01. 14.04. 14.07. 14.10.	VAR.	7.041 6.785 7.441 7.685	(L) (L) (L) (L)	N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. i VStG													
	USD	1'000.00	10.08.2016	01.02.2022	33 541 785	%	103.240	100.000	01.02. 05.05. 01.08. 01.11.	VAR.	5.993 6.334 6.589 7.268	(L) (L) (L) (L)	N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. i VStG													
	EUR	1'000.00	20.03.2017	20.09.2022	35 991 542	%	101.440	100.000	20.06. 20.09. 20.12.	VAR.	1.029 1.093 1.097	(L) (L) (L)	N
20.3.2017/20.9.2022 ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. i VStG													
	EUR	1'000.00	16.11.2015	16.11.2022	30 279 012	%	106.050	99.330	16.11.	1.750	20.463	(L)	N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. i VStG													
	USD	1'000.00	23.03.2017	23.05.2023	36 101 937	%	101.380	99.998	23.05. 23.11.	3.491	5.653 17.138	(L) (L)	N
23.3.2017/23.5.2023 ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. i VStG													
	USD	1'000.00	23.03.2017	23.05.2023	36 101 940	%	101.500	100.000	23.05. 23.08. 23.11.	VAR.	3.911 5.934 6.359	(L) (L) (L)	N
23.3.2017/23.5.2023 ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. i VStG													
	USD	1'000.00	15.08.2017	15.08.2023	37 830 264	%	99.510	100.000	15.11.	VAR.	5.728	(L)	N
15.8.2017/15.8.2023 ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. i VStG													

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF		IUP
15.8.2017/15.8.2023 ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. i VStG	USD	1'000.00	15.08.2017	15.08.2023	37 830 265	%	98.000	100.000		2.859	0.000		N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. i VStG	EUR	1'000.00	04.03.2016	04.03.2024	31 420 935	%	107.720	99.152	04.03.	2.125	22.774	(L)	N
18.5.2017/18.5.2024 ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. i VStG	CHF	200'000.00	18.05.2017	18.05.2024	36 550 151	%	101.800	100.754		0.625	0.000		N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. i VStG	EUR	1'000.00	30.11.2016	30.11.2024	34 144 033	%	103.790	99.768	30.11.	1.500	17.562	(L)	N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. i VStG	USD	1'000.00	05.04.2016	15.04.2026	32 072 291	%	103.790	99.779	15.04. 15.10.	4.125	20.658 20.112	(L) (L)	N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. i VStG	EUR	200'000.00	01.09.2016	01.09.2026	33 660 293	%	101.010	99.367	01.09.	1.250	2'858.75	(L)	N
23.3.2017/23.3.2028 ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. i VStG	USD	1'000.00	23.03.2017	23.03.2028	36 101 941	%	104.880	100.000	23.09.	4.253	20.607	(L)	N
Urner Kantonalbank, Altdorf, Schweiz													
	CHF	5'000.00	29.11.2016	27.11.2026	34 458 386	%	99.000	100.227	27.11.	0.125	6.215		N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	 %	Brutto brut lordo CHF	IUP
Valiant Bank AG, Bern, Schweiz												
	CHF	5'000.00	20.11.2012	20.11.2018	19 938 204	%	101.220	100.454	20.11.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	22.05.2014	22.11.2019	24 387 173	%	102.300	100.583	22.11.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	24.04.2013	24.04.2023	21 000 989	%	100.550	101.000	24.04.	2.500	125.00	N
	CHF	5'000.00	06.12.2017	06.12.2027	39 191 177	%	100.750	100.442		0.375	0.000	N
Valora Holding AG, Muttenz, Schweiz												
	CHF	5'000.00	30.04.2013		21 128 255	%	102.250	101.000	30.10.	4.000	200.00	N
	CHF	5'000.00	02.03.2012	02.03.2018	14 903 902	%	100.410	100.626	02.03.	2.500	125.00	N
Vaud (Canton de), Lausanne, Schweiz												
	CHF	5'000.00	07.06.2012	07.06.2022	18 193 292	%	105.650	101.607	07.06.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	18.12.2014	18.12.2024	26 156 138	%	103.950	100.289	18.12.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	24.10.2013	24.10.2033	22 448 592	%	124.600	102.020	24.10.	2.000	100.00	N
Vifor Pharma AG, St. Gallen, Schweiz												
	CHF	5'000.00	27.10.2010	27.10.2017	11 848 005		-	100.700	27.10.	2.500	125.00	N
Ville de Bienne, Schweiz												
	CHF	5'000.00	14.04.2009	12.04.2019	10 048 469	%	103.950	100.210	12.04.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	03.03.2006	03.03.2026	2 452 274	%	119.650	101.400	03.03.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	24.09.2014	24.09.2029	25 361 276	%	110.300	102.205	24.09.	1.375	68.750	N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF		IUP
Zuercher Kantonalbank, Zuerich, Schweiz													
2.125% ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG	CHF	5'000.00	30.06.2017		36 153 294	%	102.650	100.000	30.10.	0.950	15.833	(L)	N
	CHF	5'000.00	16.03.2015	16.03.2017	27 376 253		-	100.401	16.03.	0.000	0.000		N
	CHF	5'000.00	29.03.2011	29.03.2017	12 618 303		-	100.709	29.03.	1.750	87.500		N
	EUR	1'000'000.00	29.03.2017	07.07.2017	35 767 619		-	100.139	07.07.	0.000	0.000		N
	EUR	1'000'000.00	31.03.2017	10.07.2017	35 767 621		-	100.141	10.07.	0.000	0.000		N
30.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	31.01.2012	11.07.2017	14 380 833		-	101.000	30.06.	3.500	175.00		N
	EUR	1'000'000.00	30.01.2017	07.08.2017	35 259 590		-	100.205	07.08.	0.000	0.000		N
	EUR	1'000'000.00	07.03.2017	07.09.2017	35 483 614		-	100.190	07.09.	0.000	0.000		N
	EUR	1'000'000.00	17.03.2017	05.01.2018	35 767 614	%	100.000	100.303		0.000	0.000		N
	CHF	5'000.00	29.01.2013	29.01.2018	20 373 789	%	100.060	100.000	30.01. 02.05. 31.07. 30.10.	VAR.	0.000 0.000 0.000 0.000		N
	CHF	5'000.00	05.02.2010	05.02.2018	10 873 484	%	100.260	100.700	05.02.	2.125	106.25		N
	EUR	1'000'000.00	07.07.2017	07.02.2018	36 153 308	%	100.050	100.228		0.000	0.000		N
	EUR	1'000'000.00	07.08.2017	07.02.2018	36 153 313	%	100.050	100.205		0.000	0.000		N
	EUR	1'000'000.00	12.07.2017	12.02.2018	36 153 309	%	100.050	100.228		0.000	0.000		N
	EUR	1'000'000.00	11.08.2017	12.02.2018	36 153 314	%	100.050	100.216		0.000	0.000		N
	EUR	1'000'000.00	07.03.2017	07.03.2018	35 767 610	%	100.080	100.336		0.000	0.000		N
	EUR	1'000'000.00	07.09.2017	07.03.2018	36 153 321	%	100.070	100.206		0.000	0.000		N
0 % Certificates of Deposit 2017-27.03.18	EUR	1'000'000.00	27.12.2017	27.03.2018	37 347 631	%	100.090	100.160		0.000	0.000		N
	EUR	1'000'000.00	29.03.2017	29.03.2018	35 767 620	%	100.100	100.336		0.000	0.000		N
	EUR	1'000'000.00	31.03.2017	29.03.2018	35 767 622	%	100.100	100.334		0.000	0.000		N
	EUR	1'000'000.00	10.11.2017	11.05.2018	37 347 615	%	100.130	100.217		0.000	0.000		N
	EUR	1'000'000.00	21.06.2017	21.06.2018	36 153 300	%	100.170	100.366		0.000	0.000		N
	EUR	1'000'000.00	21.12.2017	21.06.2018	37 347 629	%	100.160	100.218		0.000	0.000		N
	EUR	1'000'000.00	22.06.2017	22.06.2018	36 153 301	%	100.170	100.366		0.000	0.000		N
	EUR	1'000'000.00	27.12.2017	27.06.2018	37 347 630	%	100.160	100.228		0.000	0.000		N
	CHF	5'000.00	15.12.2011	14.12.2018	14 287 834	%	101.610	100.671	14.12.	1.000	50.000		N
	CHF	5'000.00	15.04.2011	15.04.2019	12 811 444	%	103.450	101.026	15.04.	2.125	106.25		N
	CHF	5'000.00	12.05.2010	12.03.2020	11 227 278	%	105.700	100.240	12.03.	2.125	106.25		N
	CHF	5'000.00	21.01.2011	21.01.2021	12 245 675	%	107.150	100.294	21.01.	2.000	100.00		N
	CHF	5'000.00	31.03.2015	31.03.2021	27 474 026	%	101.700	100.717	31.03.	0.250	12.500		N
	CHF	5'000.00	17.05.2013	17.05.2021	21 236 581	%	103.750	100.731	17.05.	0.875	43.750		N
	CHF	5'000.00	31.01.2012	31.01.2022	14 665 215	%	105.950	100.828	31.01.	1.250	62.500		N
	CHF	5'000.00	11.02.2016	11.02.2022	30 725 640	%	100.750	100.000	11.02.	0.030	1.500		N
	CHF	5'000.00	29.06.2010	29.06.2022	11 398 256	%	110.450	101.050	29.06.	2.125	106.25		N
	CHF	5'000.00	09.12.2015	09.12.2022	30 518 653	%	100.550	100.000	09.12.	0.040	2.000		N
	CHF	5'000.00	27.01.2014	27.01.2023	23 269 871	%	107.900	100.667	27.01.	1.500	75.000		N
	CHF	5'000.00	29.03.2011	29.03.2023	12 618 307	%	112.750	101.091	29.03.	2.375	118.75		N
	CHF	5'000.00	29.01.2013	29.01.2024	20 387 286	%	106.800	100.371	29.01.	1.125	56.250		N
2.3.2015/2.9.2025 ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG	CHF	5'000.00	02.03.2015	02.09.2025	26 759 669	%	101.100	100.000	02.09.	0.680	34.000	(L)	N
	CHF	5'000.00	08.09.2010	08.09.2025	11 630 686	%	114.650	100.115	08.09.	2.000	100.00		N
	CHF	5'000.00	27.01.2017	27.01.2026	34 708 278	%	100.650	100.379		0.250	0.000		N
	CHF	5'000.00	13.05.2016	13.05.2026	31 940 375	%	99.750	100.025	13.05.	0.125	6.250		N
	CHF	5'000.00	23.11.2016	23.11.2026	34 258 763	%	98.450	100.000	23.11.	0.050	2.500		N
	CHF	5'000.00	12.04.2012	12.04.2027	18 248 411	%	112.500	100.302	12.04.	1.625	81.250		N
15.6.2015/15.6.2027 ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. g VStG	EUR	1'000.00	15.06.2015	15.06.2027	28 471 370	%	105.290	99.622	15.06.	1.715	18.641	(L)	N
	CHF	5'000.00	28.10.2015	28.10.2030	29 929 728	%	103.300	100.425	28.10.	0.750	37.500		N
	CHF	5'000.00	10.06.2011	10.06.2031	13 015 864	%	126.250	100.687	10.06.	2.500	125.00		N
	CHF	5'000.00	30.11.2010	30.11.2034	11 972 979	%	122.300	102.440	30.11.	2.000	100.00		N
	CHF	5'000.00	14.12.2010	14.12.2040	12 040 812	%	126.400	101.333	14.12.	2.000	100.00		N
Zuerich Versicherungs Gesellschaft, Zuerich, Schweiz													
	CHF	5'000.00	16.03.2011		11 760 545	%	101.650	101.000	16.05.	4.625	231.25		N
	CHF	5'000.00	16.06.2014		24 586 347	%	105.400	101.000	30.09.	2.750	137.50		N
	CHF	5'000.00	02.03.2016		31 559 385	%	105.000	100.000	02.06.	2.750	137.50		N
	CHF	5'000.00	27.07.2011	27.07.2017	13 309 061		-	100.589	27.07.	2.250	112.50		N
	CHF	5'000.00	23.11.2011	23.11.2018	14 183 557	%	102.670	100.381	23.11.	2.375	118.75		N
	CHF	5'000.00	25.06.2012	25.06.2019	18 809 874	%	102.750	101.047	25.06.	1.500	75.000		N
	CHF	5'000.00	18.09.2013	18.09.2019	22 270 597	%	102.400	100.377	18.09.	1.125	56.250		N
	CHF	5'000.00	22.07.2014	22.07.2020	24 761 125	%	101.900	100.565	22.07.	0.625	31.250		N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	CHF	5'000.00	27.07.2011	27.07.2021	13 309 063	%	110.450	100.536	27.07.	2.875	143.75	N
	CHF	5'000.00	18.09.2013	18.09.2023	22 270 598	%	109.500	100.705	18.09.	1.875	93.750	N
	CHF	5'000.00	22.07.2014	22.07.2026	24 761 126	%	109.100	100.777	22.07.	1.500	75.000	N
Zug Estates Holding AG, Zug, Schweiz												
	CHF	5'000.00	17.02.2017	17.02.2022	35 342 798	%	101.600	100.061		0.700	0.000	N
Zuger Kantonalbank, Zug, Schweiz												
	CHF	5'000.00	22.12.2009	22.12.2017	10 807 111		-	100.880	22.12.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	03.12.2010	03.12.2019	12 005 780	%	104.200	100.830	03.12.	1.750	87.500	N
	CHF	5'000.00	14.10.2010	14.10.2020	11 761 514	%	106.100	100.950	14.10.	1.875	93.750	N
	CHF	5'000.00	29.10.2013	29.10.2020	22 490 401	%	104.000	100.785	29.10.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	25.05.2011	25.05.2021	12 941 098	%	108.950	100.790	25.05.	2.375	118.75	N
	CHF	5'000.00	27.09.2011	27.09.2021	13 846 095	%	106.600	100.380	27.09.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	26.09.2012	26.09.2022	19 374 491	%	105.200	100.927	26.09.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	17.10.2014	17.10.2022	25 484 951	%	103.700	100.442	17.10.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	28.11.2011	28.11.2023	14 290 077	%	108.800	100.850	28.11.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	03.03.2015	03.03.2027	27 181 981	%	102.100	100.349	03.03.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	15.12.2016	15.12.2027	34 736 603	%	100.600	100.810	15.12.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	05.06.2012	05.06.2037	18 571 282	%	114.600	100.645	05.06.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	20.11.2012	20.11.2037	19 934 768	%	114.850	100.438	20.11.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	02.04.2013	02.04.2038	20 889 759	%	117.700	100.094	02.04.	1.650	82.500	N
Zur Rose Group AG, Steckborn, Schweiz												
	CHF	5'000.00	07.12.2012	07.12.2017	19 972 936		-	100.500	07.12.	4.125	206.25	N
Zürich (Kanton), Zürich, Schweiz												
	CHF	5'000.00	07.03.2014	07.03.2017	23 666 957		-	100.000	07.03.	VAR.	0.150	N
	CHF	5'000.00	24.11.2004	24.11.2017	1 984 796		-	100.350	24.11.	2.750	137.50	N
	CHF	5'000.00	06.12.2013	06.06.2019	22 476 152	%	101.550	100.139	06.06.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	03.12.2012	03.12.2020	19 954 352	%	102.850	100.064	03.12.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	06.10.2014	06.10.2021	25 421 222	%	102.750	100.440	06.10.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	29.07.2013	29.07.2022	21 785 067	%	107.000	100.581	29.07.	1.250	62.500	N
	CHF	5'000.00	06.12.2013	06.12.2023	22 476 153	%	109.100	100.727	06.12.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	07.03.2014	07.03.2024	23 666 959	%	108.600	100.517	07.03.	1.250	62.500	N
	CHF	5'000.00	03.12.2012	03.12.2025	19 954 354	%	108.050	100.105	03.12.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	29.07.2013	29.07.2026	21 785 068	%	113.650	100.950	29.07.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	07.03.2017	07.09.2026	35 394 537	%	99.700	100.000	07.09.	0.010	0.250	N
	CHF	5'000.00	06.10.2014	06.10.2027	25 421 223	%	108.400	100.119	06.10.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	03.12.2012	03.12.2032	19 954 356	%	112.350	100.179	03.12.	1.250	62.500	N
	CHF	5'000.00	29.07.2013	29.07.2038	21 785 069	%	128.650	101.611	29.07.	2.000	100.00	N
Zürich (Stadt), Zürich, Schweiz												
	CHF	5'000.00	27.03.2008	27.03.2017	3 826 106		-	100.840	27.03.	3.125	156.25	N
	CHF	5'000.00	25.04.2014	25.04.2017	24 033 000		-	100.000	25.01. 25.04.	VAR.	0.000 0.000	N
	CHF	5'000.00	10.09.2009	10.09.2018	10 449 305	%	102.110	100.365	10.09.	2.375	118.75	N
	CHF	5'000.00	20.02.2009	20.02.2019	4 983 675	%	103.700	101.000	20.02.	2.750	137.50	N
	CHF	5'000.00	21.08.2014	21.08.2019	24 889 057	%	101.200	100.463	21.08.	0.250	12.500	N
	CHF	5'000.00	10.06.2010	10.06.2020	10 915 274	%	106.300	100.904	10.06.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	14.08.2008	14.08.2020	4 391 841	%	110.200	100.335	14.08.	3.500	175.00	N
	CHF	5'000.00	21.04.2009	21.04.2021	3 913 940	%	110.450	101.228	21.04.	2.875	143.75	N
	CHF	5'000.00	25.04.2014	25.04.2022	24 033 001	%	105.100	100.267	25.04.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	08.06.2007	08.06.2022	3 108 408	%	114.100	100.080	08.06.	3.000	150.00	N
	CHF	5'000.00	06.03.2014	06.03.2023	23 651 678	%	106.350	100.131	06.03.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	05.07.2012	05.12.2023	18 616 261	%	106.100	100.338	05.12.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	21.02.2011	21.02.2024	12 342 327	%	114.700	100.925	21.02.	2.375	118.75	N
	CHF	5'000.00	26.09.2013	26.09.2024	22 199 981	%	110.800	100.238	26.09.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	14.02.2005	14.02.2025	2 049 864	%	119.300	100.250	14.02.	2.750	137.50	N
	CHF	5'000.00	30.09.2014	30.03.2027	25 361 258	%	107.200	100.630	30.03.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	06.03.2014	06.03.2029	23 651 683	%	115.500	100.794	06.03.	1.750	87.500	N
	CHF	5'000.00	12.04.2012	12.04.2032	18 137 704	%	114.100	100.702	12.04.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	26.09.2013	26.09.2033	22 200 041	%	124.150	101.818	26.09.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	10.03.2006	10.03.2036	2 448 418	%	134.450	100.330	10.03.	2.550	127.50	N
	CHF	5'000.00	08.05.2017	08.05.2037	36 274 829	%	98.600	100.854		0.550	0.000	N
	CHF	5'000.00	10.06.2010	10.06.2038	12 976 621	%	138.550	100.447	10.06.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	24.11.2017	24.11.2039	37 347 610	%	100.750	100.919		0.700	0.000	N
	CHF	5'000.00	26.06.2015	26.06.2040	28 495 050	%	109.450	101.697	26.06.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	18.12.2013	18.12.2043	22 853 146	%	130.400	101.487	18.12.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	21.11.2016	21.11.2046	34 144 031	%	90.750	100.212	21.11.	0.400	20.000	N

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

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 **31.12.2017** %	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	 gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	 % 	 Brutto brut lordo CHF	IUP	Klassisch/classique/classico	Hinweis\Avertissement\Nota
Basilea Pharmaceutica AG, Basel, Schweiz														
	CHF	5'000.00	23.12.2015	23.12.2022	30 539 814	107.500		100.000	23.06. 23.12.	2.750	68.750 68.750	N	N	
BKW AG, Bern, Schweiz														
1/8 % Convertilble Bonds 2014-30.09.20 Wandlung in Akt.BKW	CHF	5'000.00	30.09.2014	30.09.2020	25 359 274	149.950	97.930	100.000	30.09.	0.125	6.250	Y	N	

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

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 **31.12.2017**	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2017			IUP	Klassisch/classique/classico	HinweisAvertissement\Nota
							Em.preis prix d'ém. prezzo di em.	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar.	Datum Date Data		Brutto brut lordo			
						%	%	%		%	CHF			
Crealogix Holding AG, Zürich, Schweiz														
	CHF	5'000.00	06.11.2015	06.11.2019	29 871 584	142.000		100.000	06.11.	2.375	118.75	N	N	

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

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 **31.12.2017**	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2017			IUP	Klassisch/classique/classico	HinweisAvertissement\Nota
							Em.preis prix d'ém. prezzo di em.	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar.	Datum Date Data		Brutto brut lordo			
						%	%	%		%	CHF			
Hochdorf Holding AG, Hochdorf, Schweiz														
3.5 % Pflichtwandelanleihe 2017-30.03.20	CHF	5'000.00	30.03.2017	30.03.2020	35 275 641	101.950		100.000	30.09.	1.750	43.750	N	N	

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017**	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2017			IUP	Klassisch/classique/classico	HinweisAvertissement\Nota
							Em.preis prix d'ém. prezzo di em.	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar.	Datum Date Data		Brutto brut lordo			
						%	%	%		%	CHF			
Implenia AG, Dietlikon, Schweiz														
	CHF	5'000.00	30.06.2015	30.06.2022	28 550 935	108.000		100.000	30.06.	0.500	25.000	N	N	

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

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 **31.12.2017**	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2017			IUP	Klassisch/classique/classico	HinweisAvertissement\Nota
							Em.preis prix d'ém. prezzo di em.	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar.	Datum Date Data		Brutto brut lordo			
						%	%	%		%	CHF			
Meyer Burger Technology AG, Thun, Schweiz														
	CHF	5'000.00	24.09.2014	24.09.2020	25 344 513	-	100.000	100.000	24.09. 27.11.	5.500	275.00 48.880	N	Y	
27.11.2017 Titelumtausch: 5'000 5.5 MeyerTec 20 Cv 5.5 % (ex 4 %) 2014-24.09.20 Convertible = CHF 250.00 in bar sowie 5'102.04082 Meyer Burger N Namen-Akt (VN 10850379)														

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

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 **31.12.2017** %	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	 gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	 % 	 Brutto brut lordo CHF	IUP	Klassisch/classique/classico	Hinweis\Avertissement\Nota
Schindler Holding AG, Hergiswil, Schweiz														
	CHF	5'000.00	05.06.2013	05.06.2017	20 527 679	-	100.000	100.000	05.06.	0.328	16.400	N	N	
Swiss Life Holding AG, Zürich, Schweiz														
27.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	13.11.2013	02.12.2020	22 734 223	-	100.000	100.000	27.12.	0.000	0.000	N	Y	
Swiss Prime Site AG, Olten, Schweiz														
	CHF	5'000.00	16.06.2016	16.06.2023	32 811 156	100.650		100.000	16.06.	0.250	12.500	N	N	

Anleihen (Schweiz) / Emprunts (Suisse) / Obbligazioni (Svizzera)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

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 **31.12.2017**	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2017			IUP	Klassisch/classique/classico	HinweisAvertissement\Nota
							Em.preis prix d'ém. prezzo di em.	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar.	Datum Date Data		Brutto brut lordo			
						%	%	%		%	CHF			
Von Roll Holding AG, Breitenbach, Schweiz														
	CHF	1'000.00	18.06.2014	18.06.2020	24 523 928	100.600		100.000	18.06.	1.250	12.500	N	Y	
	CHF	1'000.00	11.04.2016	11.04.2022	31 954 490	130.000		100.000	11.04.	1.000	10.000	N	N	

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli		WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017 Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Aargauische Kantonalbank, Aarau, Schweiz													
Zertifikat 2013-Open End auf SMI	(M)	CHF	8'212.86	21 259 293	CHF	7818.950		30.05.		CHF			(I)
Tracker 2014-open end auf Nebenwertbasket	(M)	CHF	101.00	24 513 114	CHF	160.730		22.06.		CHF		1.033	(L)
Tracker 2014-open end auf Nebenwertbasket (Tranche I)	(M)	CHF	100.00	24 513 115	CHF	161.150		22.06.		CHF		1.491	(L)
Underlying Tracker 2016-open end auf AKB Immobilienfondsbasket Schweiz	(M)	CHF	100.00	34 077 227		n.v.		14.11.		CHF		1.477	(L)

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017					
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Bank J. Safra Sarasin AG, Basel, Schweiz											
(M) Tracker Certificate 2011-open end on a Dynamic Swiss Domestic Basket	CHF	1'000.00	14 358 027	CHF	1952.000		15.09. 15.09.		CHF CHF		30.013 (L) 18.193 KEP
(M) Tracker Certificate 2012-open end on Dynamic Swiss "ImmoSelect" 15.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	101.00	14 873 527		-		15.09. 15.09.		CHF CHF		1.751 (L) 0.91296 KEP
(M) Tracker Zertifikat 2012-open end auf Dynamischen GEO Basket 6.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19 332 086		-				CHF		(I)
(M) Tracker Certificates 2014-ohne festen Verfall auf Aktien	USD	125.00	22 464 862	CHF	189.540		31.12.		USD		(I)
(M) Tracker Certificates 2014-without fixed maturity on Equities	EUR	125.00	22 464 863	CHF	194.400		31.12.		EUR		(I)
(M) Underlying Tacker 2015-Ohne Verfall auf Clarte Advantage Strat Allocation	USD	997.50	22 464 889	CHF	1377.820		31.12.		USD		(I)
(M) Underlying Tracker 2015-ohne festen Verfall auf Aktien	CHF	125.00	22 464 893	CHF	173.200		31.12.		CHF		(I)
(M) Underlying Tracker 2015-ohne festen Verfall auf Aktien	USD	114.38	22 464 892	CHF	137.240		31.12.		USD		(I)
(M) Underlying Tracker 2015-ohne festen Verfall auf Aktien	EUR	1'000.00	22 464 898	CHF	1309.990		09.03.		EUR	12.327	13.232 (L)
(M) Underlying Tracker 2015-ohne festen Verfall auf SF Property Sec.Fd	CHF	12'377.45	22 464 896	CHF	14558.800		31.12.		CHF		(I)
(M) Underlying Tracker 2015-ohne festen Verfall auf Aktien	EUR	98.00	27 634 561	CHF	117.420		31.12.		EUR		(I)
(M) Underlying Tracker 2015-ohne festen Verfall auf Aktien	USD	98.00	27 634 562	CHF	100.590		31.12.		USD		(I)
(M) Underlying Tracker 2015-ohne festen Verfall auf Aktien 23.5.2017 Vorz. Rückzahlung	USD	98.00	27 634 574		-				USD		(I)
(M) Underlying Tracker 2015-o.f. Verfall auf JSS Cross Asset Risk Prem ia Ref Port	CHF	10'000.00	27 634 576	CHF	9958.280				CHF		(I)
(M) Underlying Tracker 2015-o.f. Verfall auf Europaeisches Entrepreneurial II	EUR	125.25	27 634 579	CHF	166.160		31.12.		EUR		(I)
(M) Underlying Tracker 2015- o.f. Verfall auf Aktien-Basket	USD	125.62	27 634 581	CHF	142.430		31.12.		USD		(I)
(M) Underlying Tracker 2016-open end auf GT Enhanced	EUR	1'000.00	27 634 583	CHF	1377.820		31.12.		EUR		(I)
(M) Underlying Tracker 2016-ohne festen Verfall auf Basket	USD	148.74	27 634 590	CHF	175.160		08.05. 07.11.		USD CHF	1.646	1.642 (L) 1.380 (L)
(M) Underlying Tracker 2016-ohne festen Verfall auf Aktien	CHF	1'000.00	27 634 585	CHF	1164.220		08.05. 07.11.		CHF CHF		22.716 (L) 8.570 (L)
(M) Tracker Zertifikat 2014-open End auf Basket 22.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	100.50	22 464 866		-		22.03.		CHF		0.0275 (L)
(M) Tracker Certificates auf Aktien	USD	99.00	22 464 874		-				USD		(I)
(M) Underlying Tracker 2015-ohne festen Verfall auf Aktien	CHF	108.66	27 634 559		-		31.12.		CHF		(I)
(M) Underlying Tracker 2014-ohne festen Verfall auf Aktien 30.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	100.00	22 464 885		-				USD		(I)
(M) Tracker Certificates on Goldman Basket	CHF	1'000.00	22 464 875	CHF	1105.530		30.06.		CHF		(I)
(M) Underlying Tracker auf Aktien	CHF	125.00	27 634 552	CHF	229.970		31.12.		CHF		(I)
(M) Underlying Tracker auf Aktien	EUR	125.00	27 634 553	CHF	236.770		31.12.		EUR		(I)
(M) Underlying Tracker auf Basket	CHF	100.00	27 634 555	CHF	105.860				CHF		(I)
(M) Underlying Tracker auf Aktien	CHF	164.21	27 634 568	CHF	202.190		31.12.		CHF		(I)
(M) Underlying Tracker auf Aktien	EUR	193.03	27 634 569	CHF	251.370		31.12.		EUR		(I)
(M) Underlying Tracker auf Aktien	USD	166.57	27 634 570	CHF	194.000		31.12.		USD		(I)

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
(M) Tracker Certificate on Dynamic GT Portf Bskt	EUR	2'362.09	12 968 766	CHF	4566.480		31.12.		EUR			(I)
Bank Julius Baer & Co AG, Zuerich, Schweiz												
(M) Certificates 2010-7.5.10 (Exp.30.4.10) auf Aktien	EUR	100.00	11 198 516	CHF	231.570		30.04.		EUR	10.375	11.258	(L)
(M) Certificate 2010-Open End on A.M.&C.Balanced Strategy Basket	USD	100.00	12 055 165	CHF	97.730		24.11.		USD	0.000	0.000	
(M) Actively Managed-Cert. 2012-open end on JB Equities Global Excellence North Amer	USD	100.00	14 384 887	CHF	195.130		20.06.		USD	0.5005	0.48844	(L)
(M) Cert. 2012-open end on FS Global Dynamic Strategy	EUR	100.00	19 330 398	CHF	125.200		04.10.		EUR	0.000	0.000	
(M) Actively Managed-Cert. 2012-open end on K2 High Conviction Global Equity Portfolio 7.3.2017 vorz. Rückzahlung	USD	100.00	19 877 562		-				USD			(I)
(M) Actively Managed-Cert. 2013-open end on Viburnum Strategy	EUR	100.00	14 384 917	CHF	155.040		05.04.		EUR	0.6309	0.67541	(L)
(M) Actively Managed-Zert. 2013-o.f. Verfall auf Altius Advantage Portfolio	EUR	100.00	14 384 918	CHF	140.940		10.04.		EUR	0.5422	0.57953	(L)
(M) Actively Managed-Zert. 2013-o.f. Verfall auf Altius Advantage Portfolio	USD	100.00	14 384 925	CHF	106.650		07.06.		USD	0.5487	0.52882	(L)
(M) Actively Managed-Zert. 2013-open end on JB Technical Analysis-Global Equities	USD	100.00	14 384 924	CHF	151.330		24.06.		USD			(I)
(M) Actively Managed-Zert. 2013-o.f.Verfall auf VT WM Small & Mid Cap CHF Basket	CHF	100.00	14 384 931	CHF	159.800		28.08.		CHF		0.000	
(M) Actively Managed-Zert. 2013-o.f.Verfall auf Optimized Strategy	USD	100.00	14 384 938	CHF	113.910		25.09.		USD	0.000	0.000	
(M) Actively Managed-Zert. 2013-o.f.Verfall auf Diversified Portfolio Management	EUR	100.00	14 384 937	CHF	125.320		25.09.		EUR	0.2896	0.33308	(L)
(M) Actively Managed-Zert. 2013-o.f.Verfall auf Global Dynamic Opportunities Portfolio	CHF	100.00	14 384 936	CHF	102.100		01.10. 08.10.		CHF CHF		0.000	 (I)
(M) Actively Managed-Zert. 2014-o.f. Verfall auf Strategic Asset Allocation EUR	EUR	100.00	14 384 958	CHF	118.180		18.02.		EUR			(I)
(M) Actively Managed-Zert. 2014-o.f. Verfall auf Interesta EUR Bond Basket	EUR	1'005.00	14 384 970	CHF	1211.100				EUR			(I)
(M) Zert. 2014-o.f. Verfall auf Sto Bene Partners STH Equiy Portfolio	EUR	100.00	23 618 655	CHF	135.620		11.08.		EUR	1.211	1.375	(L)
(M) Underlying Tracker 2014-o.f. Verfall auf GFG Fixed Income Strategy	EUR	100.00	25 819 936	CHF	120.400		06.11.		EUR	0.000	0.000	
(M) Underlying Tracker 2014-o.f. Verfall auf BC Swiss Success Enterprises	CHF	100.00	25 819 970	CHF	107.600		25.11.		CHF		0.8153	(L)
(M) Underlying Tracker 2014-o.f. Verfall auf Current Favorites Portfol io	USD	100.00	25 820 001	CHF	99.780		18.12.		USD	0.000	0.000	
(M) Underlying Tracker 2015-o.f. Verfall auf PHANAR Active Allocation Portfolio	EUR	100.00	25 819 969	CHF	136.200		29.12.		EUR	0.000	0.000	
(M) Underlying Tracker 2015-o.f. Verfall auf Analyst Favourite Portfolio	USD	100.00	27 019 230	CHF	99.490		19.03.		USD	0.000	0.000	
(M) Underlying Tracker 2015-o.f.Verfall auf Asia Thematic	USD	100.00	27 019 255	CHF	108.060				USD			(I)
(M) Underlying Tracker 2015-o.f. Verfall auf JB Asia Thematic Notional Portfolio	USD	100.00	27 897 211	CHF	96.520		27.05.		USD	0.5446	0.53166	(L)
(M) Underlying Tracker 2015-o.f. Verfall auf GFG Alternative Strategy	EUR	100.00	29 019 657	CHF	116.890		08.10.		EUR			(I)
(M) Underlying Tracker 2015-open end on the IWG Equity Portfolio	USD	1'000.00	30 007 639	CHF	1159.620		01.12.		USD	10.329	10.165	(L)
(M) Underlying Tracker 2016-open end on APW Balanced Asset Allocation	USD	100.00	30 594 835	CHF	104.220		04.01.		USD	0.5859	0.59979	(L)
(M) Underlying Tracker 2016-o.f. Verfall auf 7F Thematic Equity	USD	100.00	30 594 897	CHF	124.440		01.03.		USD	0.000	0.000	

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponibile CHF	
(M) Underlying Tracker 2016-ohne festen Verfall auf BI.PHA.MED Strategy	USD	100.00	32 836 308	CHF	114.790		19.07.		USD	0.000	0.000	
(M) Underlying Tracker 2016-ohne festen Verfall auf GFG VOLBIC Strategy	EUR	100.00	33 784 495	CHF	132.460		03.10.		EUR	1.198	1.371	(L)
(M) Underlying Tracker 2016-open end auf North American Growth Stocks	USD	100.00	32 836 390	CHF	124.970		11.10.		USD	0.3859	0.37531	(L)
(M) Underlying Tracker 2016-ohne festen Verfall auf DWA DM Systematic Leaders	CHF	100.00	33 226 299	CHF	108.700		21.12.		CHF		0.000	
(M) Underlying Tracker 2016-ohne festen Verfall auf DWA EM Systematic Leaders	CHF	100.00	33 226 300	CHF	125.200		21.12.		CHF		1.914	(L)
(M) Underlying Tracker 2017-open end auf Pachira Strategy	CHF	100.00	33 226 320	CHF	104.300		20.12.		CHF		0.000	
(M) Actively Managed-Zert. 2014-o.f. Verfall auf EUR Asset Allocation 7.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	100.00	14 384 962		-				EUR			(I)
(M) Underlying Tracker 2016-ohne festen Verfall auf LimmatWealth EUR 7.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	100.00	31 809 670		-		01.06.		EUR	0.8969	0.97605	(L)
(M) Underlying Tracker 2016-open end auf WMP Core Equity Basket 7.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	100.00	31 809 643		-		21.03.		CHF		0.7897	(L)
(M) Underlying Tracker auf US High Div Lead with Risk	USD	99.50	25 819 979	CHF	125.850		05.12.		USD	2.279	2.250	(L)
(M) Underlying Tracker auf US High Div Lead with Risk	USD	100.00	25 819 980	CHF	125.850		05.12.		USD	2.279	2.250	(L)
(M) Underlying Tracker auf Alphen General Basket	USD	100'000.00	25 819 999	CHF	114193.850		12.02.		USD	1'536.79	1'544.62	(L)
Bank Vontobel AG, Zürich, Schweiz												
(M) Active-Dynamic-VONCERT 2008-Open End auf "Swiss Equity Basket"	CHF	100.00	3 879 162	CHF	120.390		12.03.		CHF			(I)
(M) Active Dynamic Cert. 2012-open end on Emerging Markets Customer Basket	EUR	100.00	14 150 192	CHF	162.880		31.08.		EUR			(I)
Banque Cantonale Vaudoise, Lausanne, Schweiz												
(M) Underlying Tracker 2014-without fixed maturity on Equities	CHF	100.00	25 016 004	CHF	119.970		26.09.		CHF			(I)
(M) Underlying Tracker 2014-without fixed maturity on Basket	CHF	100.00	26 174 544		n.v.				CHF			(I)
(M) Underlying Tracker 2015-without fixed maturity on Equities	CHF	200.00	27 171 233	CHF	236.850		30.06.		CHF			(I)
(M) Underlying Tracker 2015-without fixed maturity on Basket 14.2.2017 vorz. Rückzahlung	USD	100.00	29 178 033		-		31.12.		USD			(I)
(M) Underlying Tracker 2015-without fixed maturity on Equities	CHF	100.00	29 694 425	CHF	116.260		31.12.		CHF			(I)
(M) Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on Basket	CHF	100.00	30 617 945	CHF	119.950		31.12.		CHF			(I)
(M) Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on Basket	CHF	100.00	31 057 987	CHF	126.030		31.12.		CHF			(I)
(M) Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on Basket	USD	100.00	33 686 912	CHF	112.060		31.12.		USD			(I)
(M) Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on Basket	EUR	100.00	33 686 911	CHF	130.040		31.12.		EUR			(I)
(M) Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on Basket	USD	100.00	28 459 149	CHF	99.330		31.12.		USD			(I)
(M) Certificat Tracker on Equities	EUR	100.00	23 760 167		-				EUR			(I)
(M) Certificat Tracker on Equities	USD	100.00	23 760 168		-				USD			(I)
(M) Underlying Tracker 2015-without fixed maturity on Basket 3.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	100.00	27 456 221		-		31.12.		EUR			(I)
(M) Underlying Tracker on Basket	USD	100.00	31 456 159		-				USD			(I)

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli		WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Dividend Underlying Tracker SumBasket on Equities	(M)	CHF	1.00	24 678 376		-				CHF			(I)
Dividend Underlying Tracker SumBasket on Equities	(M)	USD	100.00	22 457 697		-				USD			(I)
Dividend Underlying Tracker SumBasket on Equities	(M)	EUR	100.00	22 457 696		-				EUR			(I)
Underlying Tracker on Equities	(M)	EUR	100.00	26 180 807		-				EUR			(I)
Underlying Tracker on Equities	(M)	USD	100.00	26 180 808		-				USD			(I)
Underlying Tracker on Funds	(M)	EUR	100.00	28 113 834	CHF	125.600		31.12.		EUR			(I)
Certificat Tracker on Equities	(M)	USD	100.00	21 691 347	CHF	143.960				USD			(I)
Certificat Tracker on Equities	(M)	EUR	100.00	21 691 346	CHF	194.540				EUR			(I)
Underlying Tracker on Equities	(M)	EUR	100.00	30 405 566	CHF	117.280		31.12.		EUR			(I)
Underlying Tracker on Equities	(M)	USD	100.00	30 405 565	CHF	109.540		31.12.		USD			(I)
Underlying Tracker on Funds	(M)	USD	100.00	28 113 835	CHF	114.330		31.12.		USD			(I)
Underlying Tracker on Funds	(M)	CHF	100.00	31 740 699	CHF	116.850		31.12.		CHF			(I)
Banque Lombard Odier & Cie SA, Genève, Schweiz													
Certificate 2011-open end sur US Best Picks Basket	(M)	USD	1'002.50	12 457 977	CHF	1926.080		30.09.		USD			(I)
Tracker Certificate sur China Policy Basket	(M)	USD	1'000.00	14 096 488	CHF	1701.230		30.09.		USD			(I)
Basket Certificate 2012-open end on Equities	(M)	USD	1'005.00	18 769 609	CHF	1842.050		30.09.		USD			(I)
Tracker Certificate 2013-open end sur China Fresh Air Basket Certificate	(M)	USD	1'000.00	20 167 850	CHF	1103.220		30.09.		USD			(I)
Tracker Certificate 2013-open end on Alpha Japan Absolute Return	(M)	USD	1'000.00	22 421 000	CHF	1312.260				USD			(I)
Tracker Certificate 2014-Open End	(M)	CHF	10'000.00	22 421 002	CHF	9332.610				CHF			(I)
Certificate 2014-Open End on Basket	(M)	USD	1'000.00	22 421 007	CHF	799.140				USD			(I)
Tracker Certificate 2014-Open End on Basket	(M)	USD	100'000.00	24 545 576	CHF	9175.580		30.09.		USD			(I)
Underlying Tracker 2014-Open End on Strategy Basket	(M)	EUR	100.00	24 545 581	CHF	129.020		30.09.		EUR			(I)
Underlying Tracker 2014-open end on Atlas Equity Basket	(M)	EUR	1'000.00	24 545 582	CHF	992.640		30.09.		EUR			(I)
Underlying Tracker 2015-Open End on Swiss High Dividend Basket	(M)	CHF	1'000.00	25 621 574	CHF	1314.180		30.09.		CHF			(I)
Underlying Tracker 2015-Open on Basket	(M)	CHF	1'000.00	27 808 159	CHF	1212.950		30.09.		CHF			(I)
Tracker Certificate 2013-open end sur US Basket Certificate 16.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	(M)	USD	1'000.00	20 167 851		-				USD			(I)

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Credit Suisse AG, Zürich, Schweiz												
(M) Tracker Certificate 2010-Open End auf Zuercher Oberland Basket	CHF	1'000.00	11 102 033	CHF	2195.000		31.03.		CHF			(I)
(M) Tracker Certificates 2011-Open End on the CS Top 30 Basket	USD	100.50	11 627 396	CHF	135.120		18.04.		USD			(I)
(M) Tracker-Zert. 2011-o.f. Verfall auf Aktien-Basket	CHF	83.31	11 627 398	CHF	136.740		18.04.		CHF			(I)
(M) Tracker-Zert. 2011-o.f. Verfall auf Aktien-Basket	EUR	71.20	11 627 399	CHF	135.460		18.04.		EUR			(I)
(M) Managed Tracker-Zert. 2014-o.f. Verfall auf CS Global Pair Trades Basket	USD	10'000.00	23 651 537	CHF	8554.910		31.03.		USD			(I)
(M) Underlying Tracker 2016-open end auf Expert Investor II SICAV-SIF Star AI Fund	EUR	1'000.00	28 421 476	CHF	1105.790		31.03.		EUR			(I)
(M) Underlying Tracker 2016-open end on Credit Suisse Virtual Reality Index	USD	1'000.00	28 421 475	CHF	1876.830		31.03.		USD			(I)
(M) Underying Tracker auf Twelve Cap Ins MA I	USD	1'000.00	29 342 906	CHF	1182.030		31.03.		USD			(I)
(M) Strategy Certificate on Victus Diurni	USD	1'000.00	10 644 392	CHF	2506.340		31.03.		USD			(I)
(M) Strategy Certificate on Carpe Momentum	USD	1'000.00	18 925 203	CHF	503.800		31.03.		USD			(I)

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Leonteq Securities AG, Zuerich, Schweiz												
(M) Tracker-Zert. 2013-o.f. Verfall auf Global Sector Dynamic Investment	USD	100.00	21 820 495	CHF	99.070				USD			(I)
(M) Tracker-Zert. 2014-o.f. Verfall auf Strategic Precious Metals & Mining Ind	CAD	100.00	24 204 510	CHF	77.910				CAD			(I)
(M) Underlying Tracker 2016-o.f. Verfall auf IPC Growth Basket Index	CHF	100.00	30 179 473	CHF	100.010				CHF			(I)
(M) Tracker-Zert. auf 3-D-Printing Strategy	USD	100.00	21 229 739	CHF	114.950		21.06.		USD			(I)

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017					
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Neue Helvetische Bank AG, Zuerich, Schweiz											
(M) Actively Managed Certificates 2013-open end auf Reference Portfolio	CHF	100.00	21 930 970	CHF	152.900		02.08.		CHF		0.545 (L)
(M) Actively Managed Certificate 2013-open end auf Arsago Mexico Select	USD	100.00	22 739 644	CHF	86.920		01.11.		USD		(I)
(M) Actively Managed Certificate 2014-Open end auf equities	CHF	1.00	23 689 726	CHF	105.000		13.02.		CHF		0.166 (L)
(M) Actively Managed Certificate 2014-Open end auf Reference-Portfolio	CHF	100.00	23 761 376	CHF	157.270		24.02.		CHF		0.000
(M) Strategy Certificate 2014-open end auf adjusted Reference-Portfolio	CHF	100.00	23 971 504	CHF	95.520		28.03.		CHF		0.000
(M) Tracker Certificates 2014-Open End on Reference-Portfolio	CHF	100.00	23 793 823	CHF	136.300		15.04.		CHF		0.000
(M) Actively Managed Cerificate 2014-open end on actively Reference-Portfolio	USD	100.00	25 571 914	CHF	148.110		30.09.		USD	1.305	1.271 (L)
(M) Underlying Tracker 2014-ohne Verfall auf Funds	CHF	1.00	25 842 130	CHF	108.890		05.11.		CHF		(I)
(M) Actively Managed Certificate 2014-open end auf actively adjusted Ref.-Port. DIC EUR	EUR	1.00	26 132 628	CHF	104.490		19.11.		EUR		(I)
(M) Tracker Cretificate 2015-open end linked to "Swiss Immo Hedge"	CHF	100.00	26 989 094	CHF	102.870		06.02.		CHF		0.000
(M) Balanced Certificate 2015-Open End on actively adjusted Strategy	USD	100.00	28 058 618	CHF	100.490		29.04.		USD	0.000	0.000
(M) Underlying Tracker 2015-Open End on US Selection One Strategy	CHF	100.00	28 742 000	CHF	121.800		25.06.		CHF		0.000
(M) Underlying Tracker 2015-o.f. Verfall auf Asia Growth Basket	CHF	102.60	29 679 001	CHF	117.290		17.09.		CHF		0.238 (L)
(M) Underlying Tracker 2015-o.f. Verfall auf Strategy-Level	USD	1'000.00	30 081 069	CHF	661.850				USD		(I)
(M) Underlying Tracker 2015-o.f. Verfall auf Aktien-Basket	CHF	100.00	30 202 333	CHF	128.420				CHF		(I)
(M) Underlying Tracker 2015-o.f. Verfall on Equities	USD	100.00	30 202 334	CHF	129.110				USD		(I)
(M) Underlying Tracker 2015-o.f. Verfall auf Global Healthcare Biotech Strategy	USD	100.00	30 456 713	CHF	101.660				USD		(I)
(M) Underlying Tracker 2015-ohne festen Verfall auf Gesundheits Tracker	EUR	1.00	30 798 693	CHF	1181.110		14.12.		EUR		(I)
(M) Underlying Tracker 2016-Open End auf Strategy	EUR	100.00	31 309 142	CHF	128.610		22.02.		EUR	0.000	0.000
(M) Underlying Tracker 2016-Open End on Antibiotics Certificate	USD	100.00	31 388 302	CHF	157.270		23.02.		USD	0.000	0.000
(M) Underlying Tracker 2016-Open End on ARP SMI-Beater	CHF	100.00	31 541 128	CHF	103.300		28.02.		CHF		0.000
(M) Underlying Tracker 2016-open end auf basket	USD	100.00	32 219 029	CHF	106.380		18.04.		USD	0.000	0.000
(M) Underlying Tracker 2016-o.f.Verfall auf Bond-Basket	USD	100.00	31 655 966	CHF	78.790		25.04.		USD	5.708	5.669 (L)
(M) Underlying Tracker 2016-open end auf Refineries Oil Arbitrage Strategy	USD	100.00	32 166 465	CHF	106.770		28.04.		USD	0.000	0.000
(M) Underlying Tracker 2016-ohne festen Verfall auf Swiss Selection	CHF	1.00	32 621 217	CHF	143.280		01.06.		CHF		1.404 (L)
(M) Underlying Tracker 2016-open end auf Basket	EUR	1.00	32 987 580	CHF	126.410		23.10.		EUR	0.000	0.000
(M) Underlying Tracker 2016-open end on APB Global Opportunities	USD	1.00	33 156 591	CHF	106.280		23.10.		USD	0.000	0.000
(M) Underlying Tracker 2016-open end auf Basket	CHF	1.00	33 434 840	CHF	92.360		23.10.		CHF		0.000
(M) Underlying Tracker 2016-ohne festen Verfall auf ARP S&P Beater	USD	100.00	33 932 878	CHF	100.410				USD		(I)
(M) Actively Managed Certificate 2013-Open End auf Reference-Portfolio 31.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	22 886 889		-				CHF		(I)

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
(M) Actively Managed Certificates 2013-open end auf Reference-Portfolio	CHF	100.00	21 982 316		-				CHF			(I)
(M) Underlying Tracker auf Bonds	CHF	100.00	28 725 531	CHF	128.400		01.07. 01.07.		CHF CHF		2.623 1.125	(L) (L)
Notenstein La Roche Privatbank AG, St.Gallen, Schweiz												
(M) Tracker Certificate 2014-Open End on Parkside Constant Return Target Index	CHF	1'000.00	20 712 058	CHF	677.890		13.05.		CHF			(I)
(M) Underlying Tracker 2014-ohne festen Verfall auf Valor Health Strategy	EUR	1'000.00	24 206 656	CHF	1022.890		03.07.		EUR			(I)

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Raiffeisen Schweiz Genossenschaft, St. Gallen, Schweiz												
(M) Underlying Tracker 2014-Open end on Real Estate Fund Index	CHF	100.00	25 141 575		-				CHF			(I)

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponibile CHF	
UBS AG, Zürich und Basel, Schweiz												
(M) PERLES 2012-Without Fixed Maturity on UBS Global Quality Index	USD	156.71	18 582 862	CHF	327.170		01.01.		USD	10.450	10.752	(L)
(M) PERLES 2012-Without Fixed Maturity on UBS Global Quality Index	CHF	118.25	18 582 861	CHF	269.750		01.01.		CHF		7.930	(L)
(M) PERLES 2012-Without Fixed Maturity on UBS Global Quality Index	EUR	158.46	18 582 863	CHF	415.690		01.01.		EUR	12.560	13.419	(L)
(M) Strategy Certificates 2013-open end on Cristallina Basket	USD	100.00	21 523 718	CHF	148.340		01.01.		USD	0.000	0.000	
(M) Strategy Certificates 2013-Open End on BPER Oil & Gas Basket	USD	1'000.00	21 615 239	CHF	742.190		01.01.		USD			(I)
(M) Underlying Tracker 2016-ohne festen Verfall auf Europe Investable Index TR	EUR	49'992.00	29 815 943	CHF	68282.570		01.01.		EUR	1'453.19	1'552.66	(L)
(M) Strategy Certificate on Optimized Swiss Value Strat.	CHF	1'015.00	11 406 175		-		01.01.		CHF		0.000	
(M) Strategy Certificate on Optimized Swiss Value Strat.	CHF	1'015.00	11 406 176		-		01.01.		CHF		0.000	
(M) Strategy Certificates 2013-open end linked to the Diavolezza Basket 31.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	100.00	21 858 084	CHF	172.950		01.01.		EUR	0.000	0.000	
(M) Underlying Tracker on Basket	CHF	100.00	27 108 593	CHF	141.930		01.01.		CHF			(I)
(M) Certificates on Reference Portfolio	USD	100.00	21 253 018	CHF	70.500		01.01.		USD	0.11646	0.11983	(L)
(M) Strategy Certificates on Reyl & Cie Sa Asia	USD	100.00	21 702 064	CHF	123.740		01.01.		USD			(I)
(M) Strategy Certificates on Aqua Beatus Reference-Portfolio 31.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	4 583 003		-		01.01.		EUR			(I)
(M) Strategy Certificates on Aqua Beatus Reference-Portfolio 31.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	4 583 023		-		01.01.		USD			(I)
(M) Underlying Tracker on Basket	USD	100.00	30 155 507	CHF	164.080		01.01.		USD			(I)
(M) Underlying Tracker auf China Consumer Basket	EUR	100.00	30 100 174	CHF	176.300		01.01.		EUR			(I)
(M) Underlying Tracker on China Consumer Basket	CHF	100.00	30 012 430	CHF	163.040		01.01.		CHF			(I)
(M) Strategy Certificates auf IFS Swiss Equity 9.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'815.57	23 930 076		-		01.01.		CHF			(I)
(M) Strategy Certificates on Basket	CHF	1'815.57	23 930 075	CHF	2801.530		01.01.		CHF			(I)
(M) Tracker Certificates on Equity Basket	USD	100.00	19 272 183	CHF	166.030		01.01.		USD			(I)
(M) Strategy Certificates on Strategy Basket	EUR	1'000.00	21 737 050	CHF	1351.340		01.01.		EUR			(I)
(M) Strategy Certificates on Basket 29.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	22 180 052		-		01.01.		CHF			(I)
(M) Strategy Certificates on Technology Basket	USD	1'000.00	22 436 001	CHF	1494.040		01.01.		USD	0.000	0.000	
(M) Strategy Certificates on Calanca Dividend	EUR	100.00	22 435 914	CHF	166.530		01.01.		EUR	0.000	0.000	
(M) Tracker Zertifikate auf Basket	USD	100.00	22 836 690	CHF	111.670		01.01.		USD			(I)
(M) Strategy Certificate auf Spain Basket	EUR	100.00	23 554 719	CHF	124.160		01.01.		EUR			(I)
(M) Strategy Certificates on Reuss Eur Per L/S BSKT	EUR	1'000.00	23 554 615	CHF	1353.660		01.01.		EUR			(I)
(M) Strategy Certificates on Basket	CHF	101.50	23 684 016	CHF	159.200		01.01.		CHF			(I)
(M) Strategy Certificates on Global BuyBack Basket	EUR	100.00	23 995 771	CHF	159.030		01.01.		EUR	0.03533	0.03774	(L)
(M) Strategy Certificates on Global BuyBack Basket	USD	100.00	23 995 773	CHF	132.280		01.01.		USD			(I)
(M) Strategy Certificate auf Pentagram Italian	EUR	1'000.00	23 930 383	CHF	1339.380		01.01.		EUR			(I)

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017					
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
(M) Strategy Certificates on Reuss Swiss Basket	CHF	1'000.00	23 995 556	CHF	1250.620		01.01.		CHF		(I)
(M) Strategy Certificates on Reuss Nordic Equtes 1.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	23 995 558		-		01.01.		EUR	7.988	8.535 (L)
(M) Underlying Tracker auf Basket	EUR	100.00	32 298 389	CHF	140.410		01.01.		EUR	1.001	1.070 (L)
(M) Underlying Tracker on Gelfarth Select Strategy	EUR	100.00	32 622 396	CHF	127.520				EUR		(I)
(M) Underlying Tracker auf Basket	EUR	100.00	24 971 391	CHF	111.740		01.01.		EUR		(I)
(M) Underlying Tracker auf Basket	CHF	1'000.00	25 879 570	CHF	1408.260		01.01.		CHF		(I)
(M) Underlying Tracker auf M&A Strategy Basket	EUR	1'000.00	27 164 575	CHF	1749.600		01.01.		EUR	15.000	16.027 (L)
(M) Underlying Tracker (20.01.22) auf Basket 13.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	101.00	26 644 616		-				USD		(I)
(M) Strategy Certificate 2015-21.01.22 (Red.28.1.22) on Blue Laked Oil Basket 3.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	101.50	26 644 532		-		01.01.		USD	3.220	3.313 (L)
(M) Underlying Tracker on China Basket	USD	100.00	26 328 096	CHF	124.990		01.01.		USD		(I)
(M) Underlying Tracker auf ERER Basket	EUR	1'000.00	26 996 635	CHF	1428.740		01.01.		EUR		(I)
(M) Underlying Tracker on JPV Basket	USD	100.00	27 222 889	CHF	146.300		01.01.		USD		(I)
(M) Underlying Tracker auf JPV Internet of Things	USD	100.00	24 611 415	CHF	144.200		01.01.		USD		(I)
(M) Underlying Tracker on 2Xideas Portfolio	USD	100.00	26 685 232	CHF	121.880		01.01.		USD		(I)
(M) Underlying Tracker on Basket	CHF	100.00	26 195 533	CHF	118.250		01.01.		CHF		(I)
(M) Underlying Tracker on Basket 17.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	100.00	27 569 610		-		01.01.		EUR		(I)
(M) Underlying Tracker on Basket	EUR	100.00	27 474 654	CHF	124.650		01.01.		EUR		(I)
(M) Underlying Tracker auf Cresciano Basket	USD	100.00	27 404 288	CHF	107.530		01.01.		USD		(I)
(M) Underlying Tracker on Pearls Basket	CHF	100.00	27 826 723	CHF	126.580		01.01.		CHF		(I)
(M) Underlying Tracker auf BCC Equity Europe	EUR	100.00	27 569 609	CHF	114.010		01.01.		EUR		(I)
(M) Underlying Tracker auf BBC World Equity Bskt	EUR	100.00	28 649 666	CHF	114.010		01.01.		EUR		(I)
(M) Underlying Tracker auf Swiss Strategy	CHF	100.00	29 046 685	CHF	153.250		01.01.		CHF		(I)
(M) Underlying Tracker auf IM Emerging	USD	100.00	28 317 315	CHF	169.010				USD		(I)
(M) Certificates on UBS A&Q Alternative Solution Index (CHF)	CHF	1'000.00	3 947 994	CHF	1158.400		01.01.		CHF		(I)
(M) Certificates on UBS A&Q Alternative Solution Index (EUR)	EUR	1'000.00	3 947 714	CHF	1472.760		01.01.		EUR		(I)
(M) Certificates on UBS A&Q Alternative Solution Index (USD)	USD	1'000.00	3 947 948	CHF	1345.100		01.01.		USD		(I)
(M) Underlying Tracker on B&P Swiss Dividend Aristocrats	CHF	100.00	28 317 341	CHF	121.170		01.01.		CHF		(I)
(M) Underlying Tracker auf Dufour Capital Basket	CHF	100.00	29 579 278	CHF	136.940		01.01.		CHF		(I)
(M) Underlying Tracker auf B&P Swiss Dividend Aristocr.	CHF	100.00	28 317 363	CHF	123.270		01.01.		CHF		(I)
(M) Underlying Tracker auf Basket	USD	100.00	28 317 350	CHF	122.390		01.01.		USD		(I)
(M) Underlying Tracker auf Basket	EUR	100.00	30 382 763	CHF	124.310		01.01.		EUR		(I)
(M) Underlying Tracker auf Global Commodity ThemedBskt	USD	100.00	29 185 289	CHF	112.160		01.01.		USD		(I)
(M) Underlying Tracker auf IFS Best of Guru Eq Eur	EUR	100.00	32 622 331	CHF	129.440		01.01.		EUR		(I)

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
(M) Underlying Tracker 2016-27.06.23 auf Basket	USD	100.00	32 790 993	CHF	99.060		01.01.		USD	0.32055	0.32982	(L)
(M) Underlying Tracker on Basket 13.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	100.00	32 889 745		-		01.01.		USD	0.03086	0.03175	(L)
(M) Underlying Tracker auf Aktien 13.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	100.00	32 889 746		-		01.01.		EUR	0.02994	0.03198	(L)
(M) Underlying Tracker on Dasym Global	EUR	100.00	29 816 063	CHF	120.840		01.01.		EUR	0.17858	0.1908	(L)
(M) Underlying Tracker auf RoboCap Prime Basket	USD	100.00	32 889 672	CHF	162.120		01.01.		USD	0.27165	0.27951	(L)
(M) Underlying Tracker auf RoboCap Prime Basket	EUR	100.00	33 007 164	CHF	189.810		01.01.		EUR	0.27284	0.29151	(L)
(M) Underlying Tracker auf RoboCap Prime Basket	CHF	100.00	33 007 376	CHF	162.050		01.01.		CHF		0.27345	(L)
(M) Underlying Tracker 2015-24.08.23 on Opportunities Basket	USD	100.00	32 414 723	CHF	120.020		01.01.		USD	0.39967	0.41123	(L)
(M) Underlying Tracker auf Basket	USD	100.00	33 958 573	CHF	125.190		01.01.		USD	0.05565	0.05726	(L)
(M) Underlying Tracker on LGT Equity Top Picks Basket	CHF	1'000.00	32 520 861	CHF	1259.790				CHF			(I)
(M) Underlying Tracker auf Basket	USD	100.00	31 618 923	CHF	125.860		01.01.		USD	0.05575	0.05736	(L)
(M) Underlying tracker auf Basket	USD	100.00	31 619 166	CHF	103.390				USD			(I)
(M) Underlying Tracker auf Basket	CHF	100.00	31 619 171	CHF	104.160		01.01.		CHF			(I)
(M) Underlying tracker auf Basket	CHF	100.00	31 619 168	CHF	103.590		01.01.		CHF			(I)
(M) Underlying Tracker auf the SWM Conservative Basket	USD	100.00	33 958 566	CHF	105.710		01.01.		USD	0.00178	0.00183	(L)
(M) Strategy Certificates on Basket	CHF	10'000.00	22 966 341	CHF	10874.150		01.01.		CHF			(I)
UNION BANCAIRE PRIVEE UBP (Union Bancaire Privee CBI-TDB), Geneve, Schweiz												
(M) UBP Global Healthcare Basket Certificate 2010-open End on Equities	USD	1'257.00	11 000 737	CHF	3061.260		11.02.		USD			(I)
(M) Certificate 2011-Open end on Global Select USD Equity Basket	USD	1'000.00	12 409 393	CHF	1615.350		31.03.		USD			(I)
(M) Tracker 2013-Open End on NEW TRENDS BASKET 3.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	22 606 088		-		18.10.		USD			(I)

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Zuercher Kantonalbank, Zuerich, Schweiz												
(M) PROPER auf Schweizer Immobilien Basket	CHF	100.00	1 327 735	CHF	228.760		31.12.		CHF			(I)
(M) PROPER auf Schweizer Immobilienfonds Basket	CHF	100.00	1 781 501	CHF	203.600		31.12.		CHF			(I)
(M) TRACKER auf SWX Immofonds Index	CHF	200.35	2 414 112	CHF	364.500				CHF			(I)
(M) Cert. 2008-Open end auf QMAT Rohwaren-Strategiebasket	USD	100.00	3 894 258	CHF	35.120		16.05.		USD			(I)
(M) Proper 2009-open End auf Schweizer Immobilien	CHF	100.00	10 662 707	CHF	143.760		15.12.		CHF			(I)
(M) Dynamic PROPER 2010- Open End on Sustainability Basket	EUR	50'000.00	11 217 270	CHF	109795.170		15.12.		EUR			(I)
(M) ZKB Tracker-Zert. 2013-o.f. Verfall auf ZKB Stable Return Equity	CHF	101.00	19 270 886	CHF	127.480		15.12.		CHF			(I)
(M) ZKB Tracker-Zertifikat Dynamisch 2014-ohne festen Verfall auf Aktien	CHF	100.00	22 684 469	CHF	121.430		15.12.		CHF		3.882	(L)
(M) Underlying Tracker 2015-ohne festen Verfall auf Aktien	CHF	100.00	11 433 195	CHF	126.400		15.12.		CHF			(I)
(M) Underlying Tracker 2015-ohne festen Verfall auf Aktien	CHF	100.00	25 347 217	CHF	117.300		15.12.		CHF			(I)
(M) Underlying Tracker 2016-ohne festen Verfall auf Fonds	CHF	1'000.00	32 771 462	CHF	1100.830				CHF			(I)
(M) Underlying Tracker auf Aktien	EUR	100.00	11 433 003		-		09.06.		EUR	1.785	1.937	(L)
(M) Tracker-Zert. 2011-o.f. Verfall auf LGT Swiss Equity Portfolio 1.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	100.00	10 716 502		-				CHF			(I)
(M) Tracker-Zertifikat 2012-o.f. Verfall auf Basket 1.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	100.00	10 716 608		-				USD			(I)
(M) Underlying Tracker auf Basket	EUR	100.16	31 596 376	CHF	119.580				EUR			(I)
(M) Underlying Tracker auf Basket	CHF	100.08	31 596 375	CHF	101.040		15.12.		CHF			(I)

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	W M V	Laufzeit Durée Durata		Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Aargauische Kantonalbank, Aarau, Schweiz													
Underlying Tracker auf Bankenbasket	EUR	18.05.2015	18.05.2017	102.00	28 039 100	-		18.05.		EUR	2.187	2.381	(L)
Underlying Tracker auf Aktien	EUR	02.12.2016	04.12.2018	100.00	34 576 993	127.350		27.11.		EUR	3.832	4.480	(L)

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	WMV	Laufzeit / Durée / Durata		Nominell / Valeur nominale / Valore nominale	Valoren-Nr. / No de valeur / Numero di valore	Steuerwert / Val. imposable / Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date / Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto / Brut / lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Bank J. Safra Sarasin AG, Basel, Schweiz													
Open End Zertifikat auf Dow Jones Eurostoxx 50	EUR	04.04.2002		0.000	1 393 021	41.100		13.09.		EUR	0.4938	0.5668	(L)
Open End Zertifikat auf Swiss Market Index [SMI]	CHF	05.12.2002		0.000	1 514 763	93.300		13.09.		CHF		1.639	(L)
SaraZert Open End auf SMI MID Preis Index	CHF	18.11.2004		0.000	1 982 229	258.000		13.09.		CHF		3.016	(L)
Open End Zertifikat auf Select Dividend 20 Index	CHF	09.11.2006		0.000	2 736 899	253.750		13.09.		CHF		5.657	(L)
Tracker-Zertifikat 2011-Open End auf den EURO STOXX Sustainabil. 40 Pr Index	EUR	13.04.2011		1'014.87	12 719 062	1745.860		13.09.		EUR	24.919	28.603	(L)
Tracker Certificates 2013-ohne festen Verfall auf Aktien	CHF	15.02.2013		100.00	19 433 898	147.350		24.05.		CHF		0.39803	(L)
								23.08.		CHF		0.07296	(L)
Tracker Certificates 2013-ohne festen Verfall auf Aktien	CHF	20.09.2013		1'000.00	19 433 907	1596.000				CHF			(I)
Underlying Tracker 2015-ohne festen Verfall auf Aktien	CHF	04.02.2015		1'000.00	22 464 890	1216.000		08.02.		CHF		1.068	(L)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	29.06.2017	01.07.2019	100.00	33 985 403	97.450				CHF		0.000	
Tracker Zertifikat auf den SXI Index	CHF	15.12.2009	27.12.2019	109.70	10 813 637	145.600		20.12.		CHF		3.197	(L)
Bank Julius Baer & Co AG, Zuerich, Schweiz													
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	10.04.2015	10.04.2017	100.00	26 388 801	-		10.04.		CHF		2.000	(L)
Underlying Tracker auf Aktien	USD	15.06.2016	15.06.2017	100.00	32 519 280	-				USD			(I)
Underlying Tracker auf Aktien 17.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	17.07.2015	17.07.2017	100.00	26 388 850	-		17.07.		CHF		0.000	
Reverse Convertible auf Galenica N	CHF	18.08.2016	17.08.2017	1'150.00	24 341 707	-		17.08.		CHF		0.000	
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	09.10.2015	09.10.2017	100.00	26 388 891	-		09.10.		CHF		2.500	(L)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	25.11.2016	24.11.2017	100.00	34 205 454	-				CHF			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	USD	09.12.2016	08.12.2017	99.50	34 048 832	-				USD			(I)
Underlying Tracker auf US Top Picks Basket III	USD	22.12.2016	22.12.2017	1'000.00	34 645 159	-				USD			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	09.11.2016	27.12.2017	100.00	34 205 451	-				CHF			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	05.02.2016	05.02.2018	100.00	26 388 940	145.100		05.02.		CHF		0.000	
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	20.03.2015	20.03.2018	100.00	26 388 776	131.100		20.03.		CHF			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	16.09.2016	14.09.2018	100.00	33 029 647	131.400		14.09.		CHF		0.000	
Underlying Tracker auf Aktien	USD	07.10.2016	09.10.2018	100.00	33 740 118	113.230				USD			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	14.12.2016	13.12.2019	100.00	34 048 820	130.100				CHF			(I)
Bank Vontobel AG, Zürich, Schweiz													
Dynamic Voncert Open End auf Swiss Sector Rotation Basket	CHF	17.11.2004		0.000	1 997 574	354.000		17.11.		CHF		0.000	
Raiffeisen-Zertifikat auf Schweizer Immobilienaktien	CHF	18.11.2004		0.000	1 922 657	185.200				CHF			(I)
Open End Zertifikat auf "Zürichsee-Basket"	CHF	26.09.2006		0.000	2 674 847	239.500		20.09.		CHF		1.180	(L)
Voncert Open End auf Klimaschutz Index	CHF	12.04.2007		0.000	2 961 429	51.200				CHF			(I)
VONCERT 2008-Open End auf Troy Ounce of Gold	USD	21.01.2008		0.000	3 694 271	127.070		21.01.		USD			(I)
VONCERT 2008-Open End auf Troy Ounce of Silver	USD	21.01.2008		0.000	3 694 272	16.460		21.01.		USD			(I)
VONCERT 2008-Open End auf Platinum	USD	21.01.2008		0.000	3 694 273	8.960		21.01.		USD			(I)
VONCERT 2008-Open End auf Palladium	USD	21.01.2008		0.000	3 694 274	10.280		21.01.		USD	0.000	0.000	
Factor-Zert. 2014-o.f. Verfall auf 4X Long Index linked to Daimler AG	CHF	17.04.2014		12.20	24 197 700	5.390				CHF			(I)
Underlying Tracker 2015-o.f. Verfall auf 5xLONG Index linked to Volkswagen	CHF	30.09.2015		10.44	29 814 849	3.010		30.09.		CHF		0.000	
Voncert auf Aktien	CHF	17.02.2014	17.02.2017	100.50	14 151 094	-				CHF			(I)
Voncert auf einen Ostschweizer Basket	CHF	01.06.2007	18.05.2017	0.000	3 058 190	-				CHF			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	01.07.2015	02.07.2018	94.85	24 173 499	169.000		01.07.		CHF			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	28.10.2015	29.10.2018	94.95	29 155 037	154.400		31.12.		CHF			(I)
Banque Cantonale Vaudoise, Lausanne, Schweiz													
Tracker Certificate 2013-Open End sur Equity Basket	USD	30.08.2013		100.00	21 564 494	147.290				USD			(I)
Dividend Underlying Tracker SumBasket 2014-without fixed maturity on Equities	USD	17.04.2014		100.00	23 960 426	124.290		31.12.		USD			(I)
Certificat Tracker 2014-Open End sur Europe Stock Picking	EUR	06.05.2014		132.93	24 315 962	188.330				EUR			(I)
Dividend Underlying Tracker SumBasket 2014-without fixed maturity on Equities	CHF	30.06.2014		1.00	24 766 805	115.050		31.12.		CHF			(I)

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	WMV	Laufzeit / Durée / Durata		Nominell / Valeur nominale / Valore nominale	Valoren-Nr. / No de valeur / Numero di valore	Steuerwert / Val. imposable / Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Dividend Underlying Tracker SumBasket 2014-without fixed maturity on Equities	EUR	19.08.2014		100.00	25 202 604	141.020		31.12.		EUR			(I)
Underlying Tracker 2014-without fixed maturity on Basket	USD	14.11.2014		100.00	25 899 685	114.150				USD			(I)
Underlying Tracker 2015-without fixed maturity on Basket	CHF	17.02.2015		100.00	27 027 782	127.000		31.12.		CHF			(I)
Underlying Tracker 2015-without fixed maturity on Basket	CHF	26.02.2015		100.00	26 854 447	156.550		31.12.		CHF			(I)
Underlying Tracker 2015-without fixed maturity on Basket	EUR	23.03.2015		131.15	27 382 558	167.150		31.12.		EUR			(I)
Underlying Tracker 2015-without fixed maturity on Basket	EUR	02.04.2015		145.00	27 554 332	195.000		31.12.		EUR			(I)
Underlying Tracker 2015-without fixed maturity on Basket	USD	20.05.2015		100.00	28 114 079	94.400		31.12.		USD			(I)
Underlying Tracker 2015-without fixed maturity on Basket	CHF	26.06.2015		140.03	28 341 771	157.500		31.12.		CHF			(I)
Underlying Tracker 2015-without fixed maturity on Basket	EUR	11.09.2015		100.00	29 198 463	122.470		31.12.		EUR			(I)
Underlying Tracker 2015-without fixed maturity on Basket	USD	11.11.2015		100.00	30 166 527	117.270		31.12.		USD			(I)
Underlying Tracker 2015-without fixed maturity on Basket	USD	24.11.2015		1.00	30 405 681	135.250		31.12.		USD			(I)
Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on Basket	CHF	29.01.2016		100.00	31 166 776	119.300		31.12.		CHF			(I)
Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on Basket	CHF	09.02.2016		100.00	30 841 123	119.100		31.12.		CHF			(I)
Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on Basket	CHF	15.02.2016		99.90	31 145 162	144.500		31.12.		CHF			(I)
Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on Basket	CHF	24.02.2016		100.00	31 504 465	158.700		31.12.		CHF			(I)
Underlying Tracker 2016-open end on Equities	CHF	20.06.2016		5'000.00	32 786 054	103.620		31.12.		CHF			(I)
Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on Basket	EUR	20.06.2016		5'000.00	32 786 193	103.840		31.12.		EUR			(I)
Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on Basket	USD	15.07.2016		100.00	33 005 267	160.390		31.12.		USD			(I)
Underlying Tracker 2017-without fixed maturity on Basket	EUR	24.01.2017		1'000.00	35 045 225	1339.820		31.12.		EUR			(I)
Dividend Underlying Tracker SumBasket 2014-without fixed maturity on Equities 7.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	03.06.2014	18.02.2017	100.00	24 390 251	-		31.12.		USD			(I)
Certificat Tracker 2014-Open end sur US Industrial Renaissance 15.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	14.02.2014	28.03.2017	100.00	23 576 308	-		15.03.		USD			(I)
Certificat Tracker 2014-Open End sur North America Stock Picking 15.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	06.05.2014	28.03.2017	120.05	24 315 963	-		15.03.		USD			(I)
Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on Basket 24.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	04.08.2016	05.06.2017	100.00	33 361 200	-		31.12.		USD			(I)
Underlying Tracker 2015-without fixed maturity on Basket 24.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	27.01.2015	05.07.2017	100.00	26 773 622	-				CHF			(I)
Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on Basket 4.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	08.06.2016	15.08.2017	110.00	32 699 993	-				USD			(I)
Underlying Tracker on Equities	CHF	22.09.2014	22.09.2017	1.00	25 216 731	-				CHF			(I)
Underlying Tracker 2015-without fixed maturity on Equities 6.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	04.06.2015	06.10.2017	100.00	28 258 598	-		31.12.		EUR			(I)
Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on Basket 15.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	15.12.2016	05.01.2018	100.00	34 870 157	-		15.12.		EUR	0.000	0.000	
Underlying Tracker on Equities	EUR	22.09.2015	24.09.2018	100.00	29 664 571	168.790		31.12.		EUR			(I)
Underlying Tracker on Funds	CHF	30.11.2015	30.11.2018	1'000.00	30 372 445	1252.550		30.11.		CHF			(I)
Underlying Tracker on Basket	CHF	26.05.2016	26.05.2021	100.00	32 439 957	128.000		31.12.		CHF			(I)
Underlying Tracker on Equities	CHF	27.06.2016	05.07.2021	100.00	32 727 656	131.900		31.12.		CHF			(I)
Underlying Tracker on Equities	EUR	23.09.2016	23.09.2021	100.00	33 823 920	132.690		31.12.		EUR			(I)
Basler Kantonalbank, Basel, Schweiz													
Cert. 2008-Open End auf SPI Total Return Index	CHF	28.08.2008		59.69	4 507 074	102.700		28.08.		CHF			(I)

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	W M V	Laufzeit Durée Durata		Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data		Cp.	W M V	Brutto Brut lordo	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible	
							ex. (E)	zahlb. pay. pag.			Fr.W.	CHF	
Credit Suisse AG, Zürich, Schweiz													
Tracker Certificate 2014-ohne festen Verfall auf Aktien	USD	14.04.2014		1'000.00	23 651 529	1094.330		31.03.		USD			(I)
Tracker-Zert. auf Rogers Intl. Commodity Index	USD	11.04.2014	11.04.2017	99.00	23 651 532	-		11.04.		USD	1.000	1.006	(L)
Underlying Tracker auf Aktien	USD	30.01.2015	30.01.2018	100.00	26 249 109	126.870		30.01.		USD	0.000	0.000	
Underlying Tracker auf Aktien-Basket	USD	20.02.2015	20.02.2018	95.00	26 249 110	102.500		20.02.		USD	0.000	0.000	
Underlying Tracker auf Aktien	USD	27.03.2015	27.03.2018	100.00	26 249 121	131.450				USD			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	USD	10.04.2015	10.04.2018	100.00	26 249 122	84.380		10.04.		USD			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	19.06.2015	19.06.2018	100.00	28 421 464	109.400		19.06.		CHF			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	24.07.2015	24.07.2018	100.00	28 421 470	148.700				CHF			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	24.07.2015	24.07.2018	96.50	28 421 469	134.800		24.07.		CHF		0.000	
Underlying Tracker auf Aktien	EUR	24.07.2015	24.07.2018	100.00	28 421 468	111.330				EUR			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	USD	20.08.2015	20.08.2018	100.00	28 421 471	128.630		20.08.		USD	0.000	0.000	
Underlying Tracker auf Aktien	USD	28.11.2016	28.11.2018	100.00	28 421 479	125.410		28.11.		USD	0.000	0.000	

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	W M V	Laufzeit Durée Durata		Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data		Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
							ex. (E)	zahlb. pay. pag.					
Leonteq Securities AG, Zuerich, Schweiz													
Price Return Basket Tracker auf Aktien	USD	10.03.2014	10.03.2017	100.00	23 403 204	-		10.03.		USD			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	18.09.2014	17.03.2017	1'000.00	24 204 566	-				CHF			(I)
Underlying Tracker auf SMI	CHF	03.09.2015	03.09.2018	8'700.00	28 154 778	9425.000		03.09.		CHF		0.000	
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	18.11.2015	18.11.2019	96.75	28 154 991	121.400		18.11.		CHF			(I)
Tracker-Zert. auf Basket	EUR	12.09.2011	12.09.2021	1'000.00	13 327 026	2188.180				EUR			(I)
Tracker-Zert. auf Sol Myanmar-Focus Asia Ind	CHF	30.11.2012	30.11.2022	100.00	19 089 137	117.900		30.11.		CHF			(I)

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	W M V	Laufzeit Durée Durata		Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data		Cp.	W M V	Brutto Brut lordo	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
							ex. (E)	zahlb. pay. pag.			Fr.W.		
Merrill Lynch B.V., Schweiz													
Zertifikat auf ML Renewable Energy Index	EUR	23.02.2007	27.02.2017	0.000	2 914 380	-				EUR			(I)
Zertifikat auf ML Dynamic Vietnam Basket	USD	16.03.2007	16.03.2017	0.000	2 915 834	-		16.03.		USD	0.000	0.000	
Zertifikat auf Vietnam Basket	CHF	28.03.2007	28.03.2017	0.000	2 924 879	-		28.03.		CHF		0.000	

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	W M V	Laufzeit Durée Durata		Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data		Cp.	W M V	Brutto Brut lordo	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
							ex. (E)	zahlb. pay. pag.			Fr.W.		
Neue Helvetische Bank AG, Zuerich, Schweiz													
Underlying Tracker 2015-ohne festen Verfall auf Aktien	CHF	09.02.2015		1.00	26 950 175	143.200		09.02.		CHF		0.000	
Underlying Tracker 2016-ohne festen Verfall auf Alpha Portfolio	EUR	15.11.2016		100.00	34 333 639	132.460		17.11.		EUR	1.810	2.113	(L)
Certificate 2014-Open End auf Reference Portfolio 31.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	05.05.2014	11.11.2017	100.00	24 347 455	-		05.05.		CHF		0.376	(L)
Notenstein La Roche Privatbank AG, St.Gallen, Schweiz													
Price Return Basket Tracker auf Aktien	CHF	05.02.2014	03.02.2017	95.00	22 829 360	-				CHF			(I)
Underlying Tracker auf USD/CNY	CHF	07.11.2014	07.11.2017	1'000.00	25 141 763	-		07.11.		CHF		30.000	(L)
Underlying Tracker auf Aktien	USD	07.11.2014	07.11.2017	100.00	25 141 625	-				USD			(I)

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	W M V	Laufzeit Durée Durata		Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data		Cp.	W M V	Brutto Brut lordo	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible	
							ex. (E)	zahlb. pay. pag.			Fr.W.	CHF	
Raiffeisen Schweiz Genossenschaft, St. Gallen, Schweiz													
Underlying Tracker auf SPX Volatility Index	USD	21.03.2017	24.05.2017	15.06	34 411 871	-				USD			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	29.03.2016	29.03.2018	100.00	31 451 957	133.700		29.03.		CHF		0.000	
Underlying Tracker auf Aktien	USD	11.10.2016	11.10.2019	100.00	33 970 726	85.410		11.10.		USD	0.000	0.000	

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	W M V	Laufzeit Durée Durata		Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
UBS AG, Zürich und Basel, Schweiz													
Open End PERLES auf SMI Total Return	CHF	18.04.2001		0.000	1 218 929	173.900		18.04.		CHF			(I)
Open End PERLES auf Swiss Market Index [SMI]	CHF	10.12.2002		0.000	1 525 761	93.800		10.12.		CHF			(I)
Open End PERLES auf SXI Life Sciences Total Return Index	CHF	01.12.2004		0.000	2 004 038	423.750		01.12.		CHF			(I)
Open End PERLES auf SXI Bio & Medtech Total Return Index	CHF	01.12.2004		0.000	2 004 039	420.000		01.12.		CHF			(I)
Open End PERLES auf SMI Mid Index	CHF	05.03.2007		0.000	2 959 110	258.000		05.03.		CHF			(I)
PERLES 2007-Open End PERLES on the Swiss Leader Index	CHF	09.07.2007		141.27	3 208 520	151.800		09.07.		CHF			(I)
Mini-Future 2x Short 2009- Open End auf SMI	CHF	13.07.2009		100.00	10 192 263	7.960		01.01.		CHF			(I)
Mini-Future 2x Long 2009-Open End on SMI	CHF	13.07.2009		100.00	10 192 262	362.250		01.01.		CHF			(I)
UBS-ETT 2010- Open End on SMI Total Return Index	CHF	22.01.2010		1'015.95	10 834 741	184.410		22.01.		CHF		0.000	
UBS-ETT 2010-Open End on SLI Swiss Leader TR Index	CHF	17.03.2010		1'264.54	11 064 556	2288.000		17.03.		CHF			(I)
PERLES 2011-Open End auf MSCI Daily TR Net Switzerland Local Index	CHF	17.03.2011		155.76	12 224 444	270.000		17.03.		CHF			(I)
Open End PERLES 2011-ohne festen Verfall auf DJ CH Slc Dvd15 TRG	CHF	30.11.2011		78.48	14 399 566	228.000		30.11.		CHF			(I)
Open End PERLES auf Discount Index auf SMI 10.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	10.04.2006	01.05.2017	0.000	2 510 587	-				CHF			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	23.11.2015	23.11.2017	100.00	28 317 282	-				CHF			(I)
Tracker Certificate on Basket	USD	04.10.2013	04.10.2018	100.00	22 370 364	68.350		01.01.		USD	1.450	1.492	(L)
Strategy Certificates on SAC Gold Mining HighConv.Bskt	USD	16.12.2015	15.12.2022	1'000.00	30 155 674	1478.270		01.01.		USD			(I)

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	W M V	Laufzeit Durée Durata	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
						Datum / Date Data		Cp.	W M V	Brutto Brut lordo	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
						ex. (E)	zahlb. pay. pag.			Fr.W.		
Zuercher Kantonalbank, Zuerich, Schweiz												
TRACKER auf S&P 500 Index	USD	05.12.2001	0.000	1 321 152	26.010				USD			(I)
TRACKER auf Swiss Market Index	CHF	05.12.2001	0.000	1 321 153	93.850				CHF			(I)
TRACKER auf Dow Jones Euro Stoxx 50 Index	EUR	05.12.2001	0.000	1 321 154	40.770				EUR			(I)
TRACKER auf Nikkei 225 Index	JPY	05.12.2001	0.000	1 321 155	19.630				JPY			(I)
TRACKER auf Dax Index	EUR	13.05.2003	0.000	1 601 703	150.710				EUR			(I)
TRACKER auf SMIM Mid Total Return Index	CHF	02.02.2005	0.000	2 051 094	34.100		02.02.		CHF			(I)
Cert. 2008-Open end auf QMAT Rohwaren-Strategiebasket	USD	16.05.2008	100.00	3 894 257	62.020				USD			(I)
Cert. 2008-Open End auf ZKB Q-MAT Diversifikation CHF	CHF	20.08.2008	100.00	4 434 407	67.700		20.08.		CHF			(I)
Cert. 2008-Open End auf ZKB Q-MAT Produktion CHF	CHF	20.08.2008	100.00	4 434 408	36.750		20.08.		CHF			(I)
Cert. 2008- open end auf ZKB Q-MAT Liquiditaet CHF	CHF	20.11.2008	100.00	4 823 222	81.000		20.11.		CHF			(I)
ZKB Tracker-Zertifikat 2011-Open End auf ZKB MeinIndex Nachhaltigkeit Mobilitaet	CHF	18.03.2011	112.71	12 649 635	185.100				CHF			(I)
Tracker-Zertifikat 2011-Open End auf ZKB MeinIndex Nachhaltigkeit Wind	CHF	21.04.2011	69.11	10 716 408	77.250				CHF			(I)
Tracker-Zertifikat 2011-Open End auf ZKB MeinIndex Nachhaltigkeit Energieeff.	CHF	21.04.2011	114.00	10 716 402	167.400		21.04.		CHF			(I)
Tracker-Zertifikat 2011-Open End auf ZKB MeinIndex Nachhaltigkeit Solar	CHF	21.04.2011	80.08	10 716 406	48.500				CHF			(I)
Tracker-Zertifikat 2011-Open End auf ZKB MeinIndex Nachhaltigkeit Wasser	CHF	21.04.2011	109.19	10 716 407	212.800				CHF			(I)
Tracker-Zertifikat 2011-Open End auf ZKB MeinIndex Nachhaltigkeit Energieerz.	CHF	21.04.2011	82.08	10 716 403	108.300		21.04.		CHF			(I)
Tracker-Zertifikat 2011-Open End auf ZKB MeinIndex Nachhaltigkeit Mobilitaet	CHF	21.04.2011	112.92	10 716 404	188.800				CHF			(I)
Tracker-Zertifikat 2011-Open End auf ZKB MeinIndex Nachhaltigkeit Ressourcen	CHF	21.04.2011	111.52	10 716 405	222.800				CHF			(I)
ZKB Tracker-Cert. 2011-open end on ZKB MeinIndex Nachhalt. EM-Index	CHF	28.10.2011	100.00	10 716 476	164.300				CHF			(I)
ZKB Tracker-Zert. 2011-o.f. Verfall auf ZKB Energie TR-Index	CHF	22.12.2011	101.00	10 716 507	55.150		22.11.		CHF			(I)
ZKB Tracker-Cert. 2012-open end on ZKB MeinIndex Nachhaltigkeit Pazifik Index	CHF	27.04.2012	100.75	10 716 606	173.600				CHF			(I)
ZKB Tracker-Zertifikat 2012-open end auf ZKB MeinIndex Nachhaltigkeit Europa	CHF	27.07.2012	100.75	10 716 646	188.100				CHF			(I)
Tracker-Zertifikat 2012-open end auf ZKB MeinIndex Nachhaltigkeit Europa	CHF	27.07.2012	100'250.00	10 716 647	190890.000		15.12.		CHF			(I)
ZKB Tracker-Zertifikat Dynamisch 2013-ohne festen Verfall auf Aktien	CHF	22.02.2013	100.00	10 716 776	182.100				CHF			(I)
ZKB Tracker-Zertifikat Dynamisch 2013-ohne festen Verfall auf Aktien	CHF	22.02.2013	100.00	10 716 777	272.500		15.12.		CHF			(I)
ZKB Tracker-Zert. 2013- o.f.Verfall auf D-STRAT SPX	CHF	26.04.2013	123.25	20 976 239	188.370		26.04.		CHF			(I)
ZKB Tracker-Zert. 2014-o.f. Verfall auf Basket	CHF	21.05.2014	100.00	24 085 232	71.300		21.05.		CHF			(I)
ZKB Tracker-Zertifikat Dynamisch 2014-ohne festen Verfall auf Aktien	CHF	25.06.2014	100.00	22 684 429	151.100		15.12.		CHF			(I)
UnderlyingTracker 2015-open end on ZKB MeinIndex Nachhaltigkeit Pazifik Index	CHF	14.01.2015	100.00	25 347 141	131.460				CHF			(I)
UnderlyingTracker 2015-open end on ZKB MeinIndex Nachhaltigkeit MobilitaetInd	CHF	14.01.2015	100.00	25 347 138	126.390		15.12.		CHF			(I)
UnderlyingTracker 2015-open end on ZKB MeinIndex Nachhaltigkeit Europa Index	CHF	14.01.2015	100.00	25 347 142	128.050		15.12.		CHF			(I)
Underlying Tracker 2015-ohne festen Verfall auf Aktien	CHF	27.02.2015	1'000.00	25 347 184	1019.000		27.02.		CHF			(I)
Underlying Tracker 2015-ohne festen Verfall auf Aktien	CHF	08.12.2015	99.75	25 347 211	112.100				CHF			(I)
Underlying Tracker 2016-ohne festen Verfall auf Basket	CHF	09.02.2016	103.10	30 506 628	122.000				CHF			(I)

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	WMV	Laufzeit / Durée / Durata		Nominell / Valeur nominale / Valore nominale	Valoren-Nr. / No de valeur / Numero di valore	Steuerwert / Val. imposable / Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Underlying Tracker 2017-ohne festen Verfall auf SPI Size Premium SF	CHF	09.02.2017		100.00	34 414 516	131.000				CHF		0.000	
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	02.02.2016	02.02.2017	100.00	25 347 280	-				CHF			(I)
Underlying Tracker auf Aktien-Basket	EUR	11.02.2015	10.02.2017	100.00	25 347 157	-				EUR			(I)
ZKB Tracker-Zertifikat Dynamisch auf Aktien	EUR	14.02.2014	14.02.2017	100.00	22 684 262	-				EUR			(I)
ZKB Dynamisch Tracker-Zert. auf Basket	USD	15.02.2012	17.02.2017	100.00	10 716 571	-		17.02.		USD	0.03831	0.03835	(L)
Underlying Tracker auf Aktien	EUR	23.02.2015	23.02.2017	100.00	25 347 154	-		23.02.		EUR			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	09.03.2015	09.03.2017	100.00	25 347 175	-		09.03.		CHF			(I)
Reverse Convertible auf Sonova Hldg N	CHF	31.03.2016	28.03.2017	110.59	30 506 968	-		28.03.		CHF		0.000	
ZKB Tracker-Zertifikat auf Aktien	EUR	22.04.2014	20.04.2017	100.00	22 684 280	-				EUR			(I)
ZKB Tracker-Zertifikat auf Aktien	CHF	23.04.2014	25.04.2017	1'000.00	22 684 297	-		05.04.		CHF		0.000	
ZKB Tracker-Zertifikat auf Aktien	EUR	29.04.2014	25.04.2017	100.00	22 684 292	-				EUR			(I)
ZKB Tracker-Zertifikat auf Aktienbasket	SEK	25.05.2012	26.05.2017	10'000.00	10 716 623	-				SEK			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	USD	29.05.2015	31.05.2017	125.46	11 432 992	-		31.05.		USD			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	EUR	01.12.2015	01.06.2017	100.00	11 433 218	-		01.06.		EUR	1.467	1.597	(L)
ZKB Tracker-Zertifikat auf Aktien	CHF	03.06.2014	06.06.2017	1'000.00	22 684 431	-		06.06.		CHF		0.000	
Reverse Convertible auf Clariant N	CHF	06.06.2016	06.06.2017	15.99	30 507 395	-		06.06.		CHF		0.000	
Underlying Tracker auf Aktien	USD	08.06.2015	08.06.2017	100.00	11 432 974	-		08.06.		USD	0.75156	0.72688	(L)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	30.06.2015	30.06.2017	100.00	11 433 007	-		30.06.		CHF		2.207	(L)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	10.07.2015	11.07.2017	100.00	11 433 030	-		11.07.		CHF		0.94284	(L)
ZKB Tracker-Zertifikat auf Aktien	CHF	14.07.2014	14.07.2017	100.00	22 684 444	-				CHF			(I)
ZKB Tracker-Zertifikat auf Aktien	CAD	15.07.2014	14.07.2017	980.00	22 684 453	-		14.07.		CAD	20.000	15.237	(L)
Underlying Tracker auf Aktien	USD	14.07.2015	14.07.2017	100.00	11 433 032	-		14.07.		USD	0.65514	0.63242	(L)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	18.09.2014	18.09.2017	100.00	22 684 463	-		18.09.		CHF			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	20.10.2014	20.10.2017	1'002.00	22 684 493	-		20.10.		CHF		0.000	
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	17.10.2014	24.10.2017	100.00	22 684 478	-				CHF			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	23.12.2015	22.12.2017	1'000.00	25 347 281	-				CHF			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	24.02.2016	26.02.2018	100.00	30 506 633	145.100		28.02.		CHF		4.773	(L)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	31.03.2016	29.03.2018	1'000.00	30 506 971	1047.360				CHF			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	07.04.2015	05.04.2018	100.00	25 347 195	92.700		15.12.		CHF			(I)
Tracker-Zert. auf ZKB Gold ETF 28.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	03.04.2013	11.04.2018	101.00	20 795 558	-				CHF			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	06.05.2015	02.05.2018	992.00	11 432 958	1357.000		02.05.		CHF			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	EUR	05.05.2015	04.05.2018	100.00	11 432 954	114.850				EUR			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	EUR	10.06.2016	11.06.2018	98.25	30 507 400	151.650		11.06.		EUR	0.000	0.000	
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	07.07.2016	06.07.2018	1'000.00	32 771 143	1195.770				CHF			(I)
Underlying Tracker auf Fonds	CHF	05.08.2016	07.08.2018	100.00	32 771 281	115.400				CHF			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	03.12.2015	30.11.2018	100.00	11 433 194	97.000		03.12.		CHF			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	09.12.2015	10.12.2018	100.00	11 433 216	119.800				CHF		0.000	
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	28.07.2016	26.07.2019	96.30	32 771 246	127.600		26.07.		CHF		0.000	
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	30.09.2016	30.09.2019	100.00	32 771 463	103.400				CHF			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	EUR	04.11.2016	04.11.2019	85.00	32 771 910	128.480				EUR			(I)
Underlying Tracker auf Aktien	USD	18.11.2016	18.11.2019	100.00	32 771 880	119.660				USD			(I)
Index Tracker auf SPI Index	CHF	21.10.2010	21.10.2020	574.89	11 877 546	1046.000				CHF			(I)
Index Tracker auf SXI Real Eastate TR	CHF	21.10.2010	21.10.2020	129.91	11 877 537	195.600		21.10.		CHF			(I)
Tracker-Zertifikat auf BRIC Laender	USD	23.12.2010	23.12.2020	100.00	10 716 338	89.990		23.12.		USD			(I)
Tracker-Zertifikat auf Basket Asiatische Laender 14.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	23.12.2010	23.12.2020	100.00	10 716 339	-				EUR			(I)
Underlying Tracker auf Basket	CHF	15.11.2016	16.11.2026	1'000.00	32 771 445	1146.000				CHF			(I)

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Bank Julius Baer & Co AG, Zuerich, Schweiz												
Underlying Tracker auf Aktien	EUR	100.00	01.02.2016	01.02.2017	26 388 947		-	100.000	100.000		0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.03.2016	28.03.2017	30 689 186		-	100.000	100.000		0.000	N
Reverse Convertible auf Givaudan N	CHF	1'913.00	24.05.2016	18.05.2017	24 341 830		-	100.000	100.000		0.000	N
Reverse Convertible auf Unilever Cert	EUR	40.00	17.06.2016	13.06.2017	24 341 790		-	100.000	100.000		0.000	N
Reverse Convertible auf Burckhardt Compre N	CHF	256.40	23.08.2016	22.08.2017	24 341 708		-	100.000	100.000		0.000	N
Banque Cantonale Vaudoise, Lausanne, Schweiz												
7.55 % Reverse Convertible on Kuoni R Hldg N -B-	CHF	1'000.00	12.01.2016	12.01.2017	30 991 351		-	100.000	100.000	12.01.	0.000	Y
8 % (8.02 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.01.2016	13.01.2017	30 950 042		-	100.000	100.000	13.01.	0.000	Y
8 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.01.2016	20.01.2017	30 978 851		-	100.000	100.000	20.01.	0.000	Y
6.95 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	25.01.2016	25.01.2017	31 180 833		-	100.000	100.000	25.01.	0.000	Y
6 3/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.01.2016	27.01.2017	31 082 150		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
6 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.02.2016	02.02.2017	31 297 917		-	100.000	100.000	02.02.	0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.02.2016	03.02.2017	31 288 458		-	100.000	100.000	03.02.	0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.02.2016	03.02.2017	31 186 547		-	100.000	100.000	03.02.	0.000	Y
8.9 % Reverse Convertible on Logitech Intl N	CHF	1'000.00	03.02.2016	03.02.2017	31 186 969		-	100.000	100.000	03.02.	0.000	Y
8 % (8.02 % p.a.) Reverse Convertible on The Swatch Grp	CHF	1'000.00	04.02.2016	03.02.2017	31 334 404		-	100.000	100.000	03.02.	0.000	Y
Protection Participation on USD/CNY	CHF	1'000.00	04.02.2015	04.02.2017	26 933 595		-	98.000	98.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.02.2016	08.02.2017	30 966 456		-	100.000	100.000	08.02.	0.000	N
3 1/2 % Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	CHF	1'000.00	09.02.2016	09.02.2017	31 383 702		-	100.000	100.000	09.02.	0.000	Y
3.9 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.02.2015	10.02.2017	27 055 201		-	100.000	100.000	10.02.	0.000	N
7 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.02.2016	10.02.2017	31 337 787		-	100.000	100.000	10.02.	0.000	Y
2.85 % Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	CHF	1'000.00	10.02.2016	10.02.2017	31 408 622		-	100.000	100.000	10.02.	0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.02.2016	10.02.2017	31 337 786		-	100.000	100.000	10.02.	0.000	Y
7.3 % Reverse Convertible on Logitech Intl N	CHF	1'000.00	10.02.2016	10.02.2017	31 423 234		-	100.000	100.000	10.02.	0.000	Y
4.9 % Reverse Convertible on Equities	CHF	100.00	13.02.2015	13.02.2017	27 088 047		-	100.000	100.000	13.02.	0.000	N
6 3/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.03.2016	03.03.2017	31 601 956		-	100.000	100.000	03.03.	0.000	Y
5.2 % (5.21 % p.a.) Reverse Convertible on CS Group N	CHF	1'000.00	04.03.2016	03.03.2017	31 759 400		-	100.000	100.000	03.03.	0.000	Y
5.08 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.09.2015	16.03.2017	29 506 072		-	100.000	100.000	16.03.	0.000	N
Underlying Tracker on CS Group N	CHF	14.70	17.03.2016	17.03.2017	31 740 636		-	100.000	100.000		0.000	N
7 1/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.03.2016	24.03.2017	31 861 098		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
9.35 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.03.2016	30.03.2017	32 045 757		-	100.000	100.000	30.03.	0.000	Y
5.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	31.03.2016	31.03.2017	31 967 357		-	100.000	100.000	31.03.	0.000	Y
7.55 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	31.03.2016	31.03.2017	32 028 951		-	100.000	100.000	31.03.	0.000	Y
7.1 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	06.04.2016	06.04.2017	32 105 429		-	100.000	100.000	06.04.	0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	12.04.2016	12.04.2017	32 164 779		-	100.000	100.000	12.04.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.04.2016	13.04.2017	32 079 552		-	100.000	100.000	13.04.	0.000	Y
6.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.04.2015	18.04.2017	27 835 916		-	100.000	100.000	16.01. 18.04.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.04.2015	21.04.2017	27 433 598		-	99.999	100.000		0.000	Y
8.7 % (5.8 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	21.10.2015	21.04.2017	30 043 204		-	100.000	100.000	21.04.	0.000	Y
9 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	25.04.2016	25.04.2017	32 320 862		-	100.000	100.000	25.04.	0.000	Y
1.1 % Barrier Reverse Convertible on SMI	CHF	1'000.00	30.04.2014	28.04.2017	24 292 044		-	100.000	100.000	28.04.	0.800	N
5.3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	28.04.2016	28.04.2017	32 278 148		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
6.26 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.02.2016	08.05.2017	30 993 250		-	100.000	100.000	08.02. 08.05.	0.000 0.000	N
7.15 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	09.05.2016	09.05.2017	32 475 275		-	100.000	100.000	09.05.	0.000	Y
6.9 % Reverse Convertible on Equities 13.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	13.05.2015	12.05.2017	28 183 600		-	100.000	100.000	13.02.	0.000	N
6.6 % (6.64 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.05.2016	15.05.2017	32 555 289		-	100.000	100.000	15.05.	0.000	Y
5.65 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.05.2016	18.05.2017	32 460 722		-	100.000	100.000	18.05.	0.000	Y
5.65 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.05.2015	19.05.2017	28 161 226		-	100.000	100.000	19.05.	0.000	N
7.55 % Reverse Convertible on The Swatch Grp	CHF	1'000.00	26.05.2016	26.05.2017	32 654 636		-	100.000	100.000	26.05.	0.000	Y
5 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.05.2016	26.05.2017	32 602 043		-	100.000	100.000	26.05.	0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.05.2016	26.05.2017	32 602 044		-	100.000	100.000	26.05.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
2 1/4 % (2.26 % p.a.) Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	27.05.2016	26.05.2017	32 656 446		-	100.000	100.000	26.05.	0.000	Y
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	1'000.00	28.08.2015	29.05.2017	29 286 977		-	100.000	100.000		0.000	Y
8.05 % Reverse Convertible on ABB N	CHF	1'000.00	01.06.2016	01.06.2017	32 708 934		-	100.000	100.000	01.06.	0.000	Y
4.8 % (6.4 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	05.09.2016	05.06.2017	33 776 070		-	100.000	100.000	05.06.	0.000	Y
5.9 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.12.2015	08.06.2017	30 546 090		-	100.000	100.000	08.06.	0.000	N
3.3 % Reverse Convertible on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	08.06.2016	08.06.2017	32 778 007		-	100.000	100.000	08.06.	0.000	Y
6.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	09.06.2016	09.06.2017	32 723 433		-	100.000	100.000	09.06.	0.000	Y
7.6 % Reverse Convertible on CS Group N	CHF	1'000.00	14.06.2016	14.06.2017	32 790 464		-	100.000	100.000	14.06.	0.000	Y
3 % (3.01 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.06.2016	16.06.2017	32 891 647		-	100.000	100.000	16.06.	0.000	Y
6 1/2 % (6.52 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.06.2016	16.06.2017	32 891 649		-	100.000	100.000	16.06.	12.320	Y
9.7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.06.2016	20.06.2017	32 891 458		-	100.000	100.000	20.06.	0.000	Y
5.05 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	20.06.2016	20.06.2017	32 911 227		-	100.000	100.000	20.06.	0.000	Y
13.7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	21.06.2016	21.06.2017	32 924 920		-	100.000	100.000	21.06.	0.000	Y
7.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.06.2016	23.06.2017	32 850 025		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
14.9 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.06.2016	23.06.2017	32 850 026		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.06.2016	23.06.2017	32 879 070		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	25.02.2016	26.06.2017	31 654 079		-	100.000	100.000		0.000	Y
2 1/4 % Reverse Convertible on USSW10	CHF	1'000.00	30.06.2016	30.06.2017	33 014 737		-	100.000	100.000	30.06.	0.000	Y
3.2 % Reverse Convertible on USSW10	CHF	1'000.00	05.07.2016	05.07.2017	33 079 376		-	100.000	100.000	05.07.	0.000	Y
7 % (6.8 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.01.2016	11.07.2017	30 966 377		-	100.000	100.000	11.07.	0.000	Y
6.4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.07.2016	11.07.2017	33 052 450		-	100.000	100.000	11.07.	0.000	Y
5 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.07.2016	20.07.2017	33 180 002		-	100.000	100.000	20.07.	0.000	Y
6 3/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.07.2016	20.07.2017	33 180 003		-	100.000	100.000	20.07.	0.000	Y
4 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	21.01.2016	21.07.2017	31 020 981		-	100.000	100.000	23.01. 22.04. 21.07.	0.000 0.000 0.000	N
5.7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	21.07.2016	21.07.2017	33 307 762		-	100.000	100.000	21.07.	0.000	Y
5.35 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.07.2015	24.07.2017	28 853 928		-	100.000	100.000	24.01. 24.07.	0.000 0.000	N
2.3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	25.07.2016	25.07.2017	33 337 198		-	100.000	100.000	25.07.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	31.07.2015	31.07.2017	29 059 837		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	03.02.2015	03.08.2017	26 722 189		-	99.999	100.000		0.000	Y
5.44 % Barrier Reverse Convertible 6.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	04.08.2014	04.08.2017	25 034 604		-	100.000	100.000	06.02.	0.22583	N
5 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.08.2016	04.08.2017	33 348 662		-	100.000	100.000	04.08.	0.000	Y
2 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.02.2015	07.08.2017	26 873 276		-	100.000	100.000	06.02. 07.08.	0.000 0.000	N
4 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.02.2015	07.08.2017	26 873 275		-	100.000	100.000	06.02. 07.08.	0.000 0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.08.2016	08.08.2017	33 418 931		-	100.000	100.000	08.08.	0.000	Y
10.1 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.08.2016	15.08.2017	33 588 192		-	100.000	100.000	15.08.	0.000	Y
3 1/5 % Reverse Convertible sur Indices 17.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	17.02.2015	17.08.2017	26 951 895		-	100.000	100.000	17.02.	0.000	N
9.15 % (9.175 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.08.2016	18.08.2017	33 635 330		-	100.000	100.000	18.08.	0.000	Y
5 % (5.01 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.08.2016	18.08.2017	33 649 781		-	100.000	100.000	18.08.	0.000	Y
5.3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	25.08.2015	25.08.2017	29 198 447		-	100.000	100.000	27.02. 25.08.	0.000 0.000	N
5.36 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	25.08.2015	25.08.2017	29 235 688		-	100.000	100.000	27.02. 25.08.	0.000 0.000	N
9.6 % (9.63 % p.a.) Reverse Convertible on Galenica N	CHF	5'000.00	26.08.2016	25.08.2017	33 697 732		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
6.1 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	01.09.2016	01.09.2017	33 670 933		-	100.000	100.000	01.09.	0.000	Y
4.12 % Reverse Convertible Called for red.on 06.03.17 at 100% 6.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	100.00	04.09.2015	04.09.2017	29 338 408		-	100.000	100.000	06.03.	0.000	N
5.4 % Reverse Convertible on Equities 6.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	6'000.00	07.03.2016	05.09.2017	31 710 355		-	100.000	100.000	06.03.	0.000	N
3.2 % Reverse Convertible on Indices 13.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.09.2014	11.09.2017	25 324 446		-	100.000	100.000	13.03.	0.27586	N
5 % Reverse Convertible on Galenica N	CHF	5'000.00	12.09.2016	12.09.2017	33 873 535		-	100.000	100.000	12.09.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.09.2016	13.09.2017	33 782 943		-	100.000	100.000	13.09.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5 % Reverse Convertible Called for red.on 15.03.17 at 100% 15.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	15.09.2014	15.09.2017	25 427 614		-	100.000	100.000	15.03.	0.300	N
Protection Participation on Equities	CHF	1'000.00	16.09.2016	15.09.2017	33 752 930		-	95.000	95.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible on Indices 20.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.12.2014	19.09.2017	26 274 475		-	100.000	100.000	20.03.	0.050	N
5 1/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.09.2016	20.09.2017	33 851 021		-	100.000	100.000	20.09.	0.000	Y
1/2 % Reverse Convertible on SMI	CHF	1'000.00	24.09.2014	25.09.2017	25 427 615		-	100.000	100.000	25.09.	0.400	N
3 % Reverse Convertible on Indices 30.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.09.2014	29.09.2017	25 420 202		-	100.000	100.000	30.03.	0.300	N
7.15 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.09.2016	29.09.2017	34 082 928		-	100.000	100.000	29.09.	0.000	Y
8.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.09.2016	29.09.2017	34 068 595		-	100.000	100.000	29.09.	0.000	Y
3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.10.2016	03.10.2017	34 049 070		-	100.000	100.000	03.10.	0.000	Y
7.95 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.10.2016	04.10.2017	34 118 465		-	100.000	100.000	04.10.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	05.10.2016	05.10.2017	34 017 775		-	100.000	100.000	05.10.	0.000	Y
5.4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	05.10.2016	05.10.2017	34 017 774		-	100.000	100.000	05.10.	0.000	Y
2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	12.10.2016	12.10.2017	34 218 111		-	100.000	100.000	12.10.	0.000	Y
7.9 % Reverse Convertible Called for red.on 18.04.17 at 100% 18.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	15.10.2015	16.10.2017	30 070 829		-	100.000	100.000	16.01. 18.04.	0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	17.10.2016	17.10.2017	34 259 411		-	100.000	100.000	17.10.	0.000	Y
10 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.10.2016	27.10.2017	34 283 986		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.10.2016	27.10.2017	34 343 899		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
5 % Reverse Convertible on The Swatch Grp	CHF	1'000.00	27.10.2016	27.10.2017	34 357 615		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
5 1/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.10.2016	27.10.2017	34 266 797		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
3.1 % Reverse Convertible on Indices 28.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.04.2015	30.10.2017	27 848 373		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	N
6 1/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	10.11.2016	10.11.2017	34 474 250		-	100.000	100.000	10.11.	0.000	Y
9.48 % Reverse Convertible on Equities 20.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.05.2016	17.11.2017	32 476 015		-	100.000	100.000	20.02.	0.000	N
5.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.11.2016	17.11.2017	34 457 737		-	100.000	100.000	17.11.	0.000	Y
6.00 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.11.2016	17.11.2017	34 491 558		-	100.000	100.000	17.11.	0.000	Y
2.40 % Reverse Convertible on Nestle N	CHF	1'000.00	22.11.2016	22.11.2017	34 661 329		-	100.000	100.000	22.11.	0.000	Y
4.70 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.11.2016	24.11.2017	34 706 315		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
7.00 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.11.2016	24.11.2017	34 702 723		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
7.11 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.11.2016	29.11.2017	34 647 262		-	100.000	100.000	29.11.	0.000	Y
5.20 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.11.2016	30.11.2017	34 660 421		-	100.000	100.000	30.11.	0.000	Y
5.30 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.11.2016	30.11.2017	34 660 420		-	100.000	100.000	30.11.	0.000	Y
3 % Reverse Convertible Called for red.on 06.06.17 at 100% 6.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	05.06.2015	05.12.2017	28 318 063		-	100.000	100.000	06.06.	0.000	N
6.1 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.12.2016	06.12.2017	34 820 643		-	100.000	100.000	06.12.	0.000	Y
3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.12.2016	06.12.2017	34 847 761		-	100.000	100.000	06.12.	0.000	Y
5.75 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.12.2016	08.12.2017	34 778 591		-	100.000	100.000	08.12.	0.000	Y
5.25 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.12.2016	08.12.2017	34 778 590		-	100.000	100.000	08.12.	0.000	Y
3.25 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	20.12.2016	20.12.2017	35 010 960		-	100.000	100.000	20.12.	0.000	Y
6.5 % (7.18 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.01.2017	22.12.2017	35 448 419		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
5.25 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.12.2016	29.12.2017	35 003 037		-	100.000	100.000	29.12.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.01.2017	26.01.2018	35 357 504	%	104.720	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.01.2017	26.01.2018	35 357 503	%	103.830	100.000	100.000		0.000	Y
4.9 % (2.45 % p.a.) Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	05.02.2016	05.02.2018	31 128 701	%	101.270	100.000	100.000	06.02.	0.000	N
3.9 % Reverse Convertible on Indices 6.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	05.02.2016	05.02.2018	31 053 530		-	100.000	100.000	06.02.	0.000	N
3 1/4 % Reverse Convertible on Indices 6.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.07.2015	06.02.2018	28 524 337		-	100.000	100.000	06.01. 06.07.	0.000 0.000	N
3.7 % Reverse Convertible on Indices 7.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.08.2015	06.02.2018	29 006 639		-	100.000	100.000	06.02. 07.08.	0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	06.02.2017	06.02.2018	35 487 728	%	104.610	100.000	100.000		0.000	Y
4.75 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	09.02.2017	09.02.2018	35 483 841	%	101.090	100.000	100.000		0.000	Y
5.1 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	09.02.2017	09.02.2018	35 483 840	%	103.840	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.02.2017	13.02.2018	35 641 210	%	105.860	100.000	100.000		0.000	Y
8.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.02.2017	14.02.2018	35 661 765	%	107.690	100.000	100.000		0.000	Y
7.8 % (7.9 % p.a.) Reverse Convertible on Logitech Intl N	CHF	1'000.00	16.02.2017	16.02.2018	35 689 583	%	107.290	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5 % (5.01 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.02.2017	16.02.2018	35 706 732	%	104.770	100.000	100.000		0.000	Y
5.15 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.02.2017	23.02.2018	35 672 368	%	103.870	100.000	100.000		0.000	Y
5.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.02.2017	23.02.2018	35 672 369	%	104.690	100.000	100.000		0.000	Y
4.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	28.02.2017	28.02.2018	35 819 740	%	103.270	100.000	100.000		0.000	Y
6.75 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	28.02.2017	28.02.2018	35 821 222	%	100.150	100.000	100.000		0.000	Y
4 1/2 % Reverse Convertible on Indices 2.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	02.09.2015	02.03.2018	29 275 335		-	100.000	100.000		0.000	N
3.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.03.2017	06.03.2018	35 753 693	%	102.000	100.000	100.000		0.000	Y
8.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.03.2017	06.03.2018	35 753 694	%	106.910	100.000	100.000		0.000	Y
5.39 % Reverse Convertible on CieFinRichemont N	CHF	1'000.00	13.03.2017	13.03.2018	35 946 900	%	103.850	100.000	100.000		0.000	Y
4.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.03.2017	15.03.2018	36 006 292	%	104.340	100.000	100.000		0.000	Y
4.97 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	05.10.2016	05.04.2018	34 068 552	%	106.100	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.04.2017	06.04.2018	36 155 603	%	103.380	100.000	100.000		0.000	Y
8.45 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.04.2017	13.04.2018	36 330 327	%	105.620	100.000	100.000		0.000	Y
6.8 % Reverse Convertible on Galenica N	CHF	5'000.00	25.04.2017	25.04.2018	36 475 303	%	104.870	100.000	100.000		0.000	Y
5.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.05.2018	32 241 273	%	104.780	100.000	100.000	04.05.	0.000	N
6.30 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	11.11.2016	11.05.2018	34 297 988	%	101.280	100.000	100.000	11.05. 13.11.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.05.2017	11.05.2018	36 657 886	%	99.410	100.000	100.000	11.08. 13.11.	0.000 0.000	Y
9.00 % Reverse Convertible on Equities 21.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	21.11.2016	22.05.2018	34 618 928		-	100.000	100.000	21.02. 22.05. 21.08.	0.000 0.000 0.000	N
6.5 % Reverse Convertible on Equities 27.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	25.11.2016	25.05.2018	34 514 665		-	100.000	100.000	26.05. 27.11.	0.000 0.000	N
7 % Reverse Convertible on Adecco Group N	CHF	1'000.00	29.05.2017	29.05.2018	36 899 313	%	101.650	100.000	100.000		0.000	Y
4.1 % Reverse Convertible on Indices 6.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	04.12.2015	04.06.2018	30 406 510		-	100.000	100.000	06.06.	0.000	N
Reverse Convertible on Lonza Grp N	CHF	1.00	08.02.2017	08.06.2018	35 581 912	CHF	173.900	100.000	100.000		0.000	Y
5.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.06.2016	14.06.2018	32 829 696	%	104.500	100.000	100.000	14.06.	0.000	N
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.06.2017	15.06.2018	37 098 284	%	102.540	100.000	100.000		0.000	Y
5.325 % (7.1 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.09.2017	18.06.2018	38 267 201	%	103.370	100.000	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.06.2017	20.06.2018	37 140 585	%	101.730	100.000	100.000		0.000	Y
2.4 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	30.06.2015	02.07.2018	28 725 310	%	101.840	100.000	100.000	30.06.	0.000	N
6.8 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	04.07.2017	04.07.2018	37 311 557	%	97.670	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	CHF	1'000.00	10.07.2017	10.07.2018	37 153 117	%	100.080	95.000	95.000		0.000	Y
5.75 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.07.2017	18.07.2018	37 503 876	%	103.440	100.000	100.000		0.000	Y
4.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.07.2017	20.07.2018	37 422 431	%	100.810	100.000	100.000		0.000	Y
4.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.07.2017	26.07.2018	37 438 444	%	102.880	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Barrier Reverse Convertible on Equities 8.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.08.2014	06.08.2018	25 183 897		-	100.000	100.000	06.02. 08.05.	0.450 0.450	N
5.8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	23.08.2017	23.08.2018	37 975 563	%	103.700	100.000	100.000		0.000	Y
6.1 % Reverse Convertible on Equities 13.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	13.09.2016	13.09.2018	33 874 799		-	100.000	100.000	13.03. 13.06. 13.09.	0.000 0.000 0.000	N
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	21.09.2017	21.09.2018	38 280 015	%	86.350	100.000	100.000		0.000	Y
6.91 % (8.26 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.11.2017	01.10.2018	39 315 801	%	99.240	100.000	100.000		0.000	Y
3.3 % Reverse Convertible on UBS Group N	CHF	1'000.00	05.10.2017	05.10.2018	38 460 047	%	102.490	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 10.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.10.2015	08.10.2018	29 965 628		-	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Hennes&Mauritz -B-	CHF	1'000.00	11.10.2017	11.10.2018	38 582 910	%	81.580	100.000	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	12.10.2017	12.10.2018	38 460 051	%	99.780	100.000	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	12.10.2017	12.10.2018	38 583 088	%	99.710	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities 19.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung 19.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	21.10.2016	19.10.2018	34 173 199		-	100.000	100.000	19.04. 19.10.	0.000 0.000	N

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4 % Reverse Convertible on Indices	CHF	5'000.00	30.10.2015	30.10.2018	30 101 080	%	102.050	100.000	100.000	30.10.	0.000	N
3 % Reverse Convertible on Indices 31.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	31.10.2016	31.10.2018	34 181 144		-	100.000	100.000	31.01. 28.04. 31.07. 31.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
6.7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.11.2017	06.11.2018	38 953 992	%	97.990	100.000	100.000		0.000	Y
6 % (6.545 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.12.2017	07.11.2018	39 350 958	%	100.400	100.000	100.000		0.000	Y
8.92 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	09.11.2017	09.11.2018	38 994 772	%	100.620	100.000	100.000		0.000	Y
5.1 % Reverse Convertible on The Swatch Grp I	CHF	1'000.00	09.11.2017	09.11.2018	39 018 999	%	100.930	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	99.30	16.11.2015	16.11.2018	30 381 486	CHF	134.590	99.960	100.000		0.000	Y
6.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.11.2017	23.11.2018	39 080 471	%	100.110	100.000	100.000		0.000	Y
2.4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.12.2017	04.12.2018	39 350 954	%	99.340	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	1'000.00	04.10.2016	05.12.2018	34 118 558	%	109.140	100.000	100.000		0.000	Y
3.15 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	06.12.2017	06.12.2018	39 404 006	%	100.410	100.000	100.000		0.000	Y
5.3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.12.2017	07.12.2018	39 288 509	%	99.340	100.000	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	14.12.2016	14.12.2018	34 795 989	%	101.780	100.000	100.000	14.12.	0.000	N
4 % Reverse Convertible on Indices 19.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung 19.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.12.2016	19.12.2018	34 819 801		-	100.000	100.000	19.06. 19.12.	0.000 0.000	N
3 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	21.08.2017	20.12.2018	37 908 528	%	100.210	100.000	100.000	20.12.	0.000	N
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	21.12.2017	21.12.2018	39 472 426	%	100.290	100.000	100.000		0.000	N
Reverse Convertible on Equities 23.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	23.12.2016	24.12.2018	34 336 498		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
3 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	28.07.2017	28.01.2019	37 612 312	%	99.590	100.000	100.000	30.10.	0.000	N
3.5 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	11.03.2016	11.03.2019	31 603 084	%	105.000	100.000	100.000	13.03.	0.000	N
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.05.2017	06.05.2019	34 588 864	%	103.210	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.07.2017	08.07.2019	35 991 560	%	92.930	100.000	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	12.08.2016	12.08.2019	33 496 712	%	103.030	100.000	100.000	14.08.	0.000	N
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	05.09.2017	05.09.2019	38 115 472	%	100.990	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 23.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	22.10.2015	22.10.2019	30 146 924		-	100.000	100.000		0.000	Y
3.75 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	12.05.2017	12.11.2019	36 548 325		n.v.	100.000	100.000	13.11.	0.000	N
Reverse Convertible on Basket	CHF	1'000.00	17.01.2017	17.01.2020	35 324 233	%	103.270	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 24.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	24.02.2015	24.02.2020	27 175 734		-	99.999	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	28.10.2015	28.04.2020	30 202 076	%	124.070	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on SMI 27.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	26.05.2015	26.05.2020	28 300 798		-	100.000	100.000		0.000	Y
4.855 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	31.08.2017	31.08.2020	37 845 168	%	98.520	100.000	100.000	30.11.	0.000	N
Reverse Convertible on Indices 1.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	01.09.2016	01.09.2020	33 754 457		-	100.000	100.000	01.03. 01.06.	0.000 0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	21.09.2017	21.09.2020	38 311 116	%	101.590	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.01.2017	14.12.2020	35 264 705	%	99.130	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.04.2017	18.04.2022	36 438 325	%	97.360	100.000	100.000	18.10.	0.000	Y
Reverse Convertible on SMI	CHF	1'000.00	29.11.2017	29.11.2022	39 290 713	%	99.640	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	29.11.2017	29.11.2022	39 304 263	%	101.350	100.000	100.000		0.000	Y
BSI SA, Lugano, Schweiz												
3 % (6.39 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.11.2016	02.05.2017	34 540 310		-	100.000	100.000	02.05.	0.000	N
5.6 % Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	12.08.2016	12.05.2017	33 599 207		-	100.000	100.000	12.05.	0.000	N

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Corner Banca SA, Lugano, Schweiz												
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	03.03.2016	06.03.2017	24 766 796		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	03.03.2016	06.03.2017	24 766 797		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on iShs EUR STOX50 EUR	EUR	1'000.00	21.09.2015	21.03.2017	24 766 754		-	99.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Apple	USD	1'000.00	05.10.2015	05.04.2017	24 766 764		-	99.080	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.04.2016	11.04.2017	31 468 109		-	100.000	100.000	11.04.	7.540	Y
16.6 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.04.2016	18.04.2017	31 468 102		-	100.000	100.000	11.01. 18.04.	0.000 0.000	N
16.4 % Reverse Convertible on Glencore	CHF	1'000.00	25.04.2016	25.04.2017	31 468 121		-	100.000	100.000	23.01. 25.04.	0.000 0.000	N
13 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.03.2016	23.06.2017	31 468 085		-	100.000	100.000	21.03. 23.06.	0.000 0.000	N
3 % Reverse Convertible on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	23.06.2016	23.06.2017	31 468 190		-	100.000	100.000	23.03. 23.06.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.07.2016	18.07.2017	31 468 198		-	100.000	100.000	18.07.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	28.01.2016	28.07.2017	24 766 780		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
11 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.05.2016	17.08.2017	31 468 140		-	100.000	100.000	14.02. 12.05. 17.08.	0.000 0.000 0.000	N
6 % Reverse Convertible on Apple	CHF	1'000.00	25.08.2016	25.08.2017	31 468 251		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
8.67 % Reverse Convertible on Generali	CHF	1'000.00	25.08.2016	25.08.2017	31 468 253		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
Reverse Convertible on Schneider Electric	EUR	46.10	07.07.2016	07.09.2017	31 468 196		-	100.000	100.000		0.000	Y
8 1/4 % Reverse Convertible on Adecco Group N	CHF	1'000.00	14.09.2016	14.09.2017	31 468 275		-	100.000	100.000	14.09.	0.000	Y
19 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.10.2016	05.10.2017	31 468 290		-	100.000	100.000	03.01. 31.03. 03.07. 05.10.	2.366 2.302 2.215 2.249	N
Reverse Convertible on L'Oreal	EUR	151.97	05.08.2016	06.10.2017	31 468 224		-	100.000	100.000		0.000	Y
17.4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.10.2016	17.10.2017	31 468 301		-	100.000	100.000	12.01. 13.04. 13.07. 17.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
8.1 % Reverse Convertible on Carrefour	CHF	1'000.00	27.10.2016	27.10.2017	31 468 329		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
4.10 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.11.2016	14.11.2017	31 468 348		-	100.000	100.000	14.02. 14.05. 14.08. 14.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	01.06.2016	04.12.2017	31 468 157		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	01.06.2016	04.12.2017	31 468 158		-	98.570	100.000		0.000	Y
13 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	12.09.2016	12.12.2017	31 468 255		-	100.000	100.000	09.03. 09.06. 07.09. 12.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.03.2017	01.06.2018	31 468 472	%	95.840	98.330	100.000		0.000	Y
11 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.07.2017	03.07.2018	35 553 226	%	102.380	100.000	100.000	29.09.	0.000	N
4.3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.08.2017	29.08.2018	35 553 303	%	100.880	100.000	100.000	29.11.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	04.03.2016	04.09.2018	24 766 795	%	119.470	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	03.03.2017	04.09.2018	31 468 456	%	104.170	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.03.2017	04.09.2018	31 468 455	%	104.710	98.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	03.03.2017	04.09.2018	31 468 457	%	104.330	100.000	100.000		0.000	Y
7.85 % Reverse Convertible on Funds	EUR	1'000.00	30.10.2017	30.10.2018	38 233 409	%	96.780	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	14.08.2017	14.11.2018	35 553 279	%	100.790	98.160	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	14.08.2017	14.11.2018	35 553 277	%	99.960	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	14.08.2017	14.11.2018	35 553 278	%	100.240	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Telefonica Br	EUR	8.31	30.06.2017	03.01.2019	35 553 241	CHF	8.950	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.07.2017	04.01.2019	35 553 240	%	102.000	100.000	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.08.2017	18.02.2019	35 553 282	%	98.220	100.000	100.000	16.11.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	18.03.2016	18.03.2019	31 468 077	%	125.050	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	25.04.2016	25.04.2019	31 468 114		n.v.	100.000	100.000	19.01. 21.04. 20.07. 19.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
8.2 % Reverse Convertible on Equities 20.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	25.04.2016	25.04.2019	31 468 113		-	100.000	100.000	19.01. 21.04. 20.07.	0.000 0.000 0.000	N

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2017		IUP
								Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	
2.4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	25.04.2016	25.04.2019	31 468 106	%	100.550	100.000	100.000	19.01. 21.04. 20.07. 19.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.10.2016	07.10.2019	31 468 293	%	100.780	100.000	100.000	05.01. 04.04. 05.07. 04.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Basket 5.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	25.10.2016	08.11.2019	31 468 324		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 11.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.11.2016	18.11.2019	31 468 349		-	100.000	100.000		0.000	Y
5.00 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	25.11.2016	25.11.2019	31 468 370	%	100.580	100.000	100.000	23.02. 23.05. 23.08. 23.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
10.00 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	25.11.2016	25.11.2019	31 468 356		n.v.	100.000	100.000	24.02. 23.05. 23.08. 23.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	24.03.2016	21.04.2020	31 468 092	%	122.790	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.11.2017	03.11.2020	38 233 413	%	88.960	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on iShs EUR STOX50 EUR	USD	1'000.00	31.03.2017	31.03.2021	31 468 519	%	99.140	92.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	20.09.2017	20.09.2021	35 553 335	%	98.240	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	 gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	 Brutto brut lordo CHF	IUP
EFG Bank AG, Zuerich, Schweiz												
Fiduciary Certificates 2004-Without Fixed Mty Dt Cons of Parti.Nts	EUR	1'000.00	10.11.2004		1 985 918	%	60.000			02.05. 30.10.	3.434 5.645	N

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Leonteq Securities AG, Zuerich, Schweiz												
Reverse Convertible auf Tesla Motors	USD	1'000.00	06.07.2015	06.01.2017	26 670 863		-	98.940	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.01.2016	06.01.2017	27 479 748		-	100.000	100.000	06.01.	0.000	Y
Reverse Convertible auf Apple	EUR	1'000.00	09.07.2015	09.01.2017	27 479 455		-	99.870	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.01.2015	16.01.2017	26 105 359		-	100.000	100.000	16.01.	0.000	N
Underlying Tracker auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	16.01.2015	16.01.2017	24 203 956		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Novartis N	CHF	1'000.00	16.01.2015	16.01.2017	24 203 957		-	100.000	100.000		0.000	Y
7 % (4.67 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	17.07.2015	17.01.2017	28 154 541		-	100.000	100.000	17.01.	10.220	Y
7 % (4.67 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.07.2015	17.01.2017	28 154 538		-	100.000	100.000	17.01.	0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.01.2015	20.01.2017	26 670 336		-	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.01.2016	20.01.2017	30 179 658		-	100.000	100.000	20.01.	0.000	Y
Worst of Express Certificate auf Indizes	USD	1'000.00	23.01.2014	23.01.2017	23 403 165		-	97.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	22.01.2015	23.01.2017	26 670 344		-	98.770	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf S&P GSCI Crd Oil ER	USD	1'000.00	23.07.2015	23.01.2017	28 154 511		-	98.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	22.01.2015	24.01.2017	26 670 357		-	98.770	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.01.2015	26.01.2017	26 105 380		-	100.000	100.000	26.01.	0.000	N
11.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.10.2015	26.01.2017	28 154 977		-	100.000	100.000	26.01.	0.000	N
3.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.01.2015	27.01.2017	26 670 386		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	N
7.7 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.01.2016	27.01.2017	30 179 690		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
Reverse Convertible auf Bombard -B-SubVtg	EUR	1'000.00	30.01.2015	30.01.2017	24 204 014		-	99.740	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	30.01.2015	30.01.2017	26 670 368		-	100.000	100.000	30.01.	0.000	N
8 % (5.33 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	30.07.2015	30.01.2017	28 154 620		-	100.000	100.000	30.01.	1.270	Y
7 % (4.67 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	30.07.2015	30.01.2017	28 154 591		-	100.000	100.000	30.01.	9.270	Y
7 % (4.67 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.07.2015	30.01.2017	28 154 593		-	100.000	100.000	30.01.	0.000	Y
7 % (4.67 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	30.07.2015	30.01.2017	28 154 592		-	100.000	100.000	30.01.	1.430	Y
7 % (4.67 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.07.2015	30.01.2017	28 154 590		-	100.000	100.000	30.01.	0.000	Y
10 % (6.67 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	30.07.2015	30.01.2017	28 154 602		-	100.000	100.000	30.01.	2.070	Y
10.8 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	30.10.2015	30.01.2017	28 155 006		-	100.000	100.000	30.01.	0.0533	N
9 % (6 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	31.07.2015	31.01.2017	28 154 625		-	100.000	100.000	31.01.	1.750	Y
Underlying Tracker auf Aktien	USD	1'000.00	03.02.2015	03.02.2017	24 204 039		-	98.480	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf SMI	CHF	1'000.00	06.02.2015	06.02.2017	24 204 061		-	90.000	90.000		0.000	Y
4.40 % Reverse Convertible auf Basket	CHF	1'000.00	06.02.2015	06.02.2017	26 670 421		-	100.000	100.000	06.02.	0.000	N
6.14 % Reverse Convertible auf Aryzta N	CHF	1'000.00	06.08.2015	06.02.2017	27 479 531		-	100.000	100.000	06.02.	0.000	N
9 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	06.11.2015	06.02.2017	28 155 041		-	100.000	100.000	06.02.	0.000	N
7 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.02.2016	08.02.2017	30 179 728		-	100.000	100.000	08.02.	0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.02.2015	13.02.2017	26 670 457		-	100.000	100.000	13.02.	0.000	N
7 1/4 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	17.02.2016	17.02.2017	30 179 770		-	100.000	100.000	17.02.	0.000	Y
7 % (4.66 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	19.08.2015	20.02.2017	28 154 711		-	100.000	100.000	20.02.	1.440	Y
Reverse Convertible auf Basket	CHF	1'000.00	20.08.2015	20.02.2017	27 479 566		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Basket	EUR	1'000.00	20.08.2015	20.02.2017	27 479 567		-	99.910	100.000		0.000	Y
7 % (4.67 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.08.2015	21.02.2017	28 154 733		-	100.000	100.000	21.02.	0.000	Y
7 % (4.67 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.08.2015	21.02.2017	28 154 734		-	100.000	100.000	21.02.	0.000	Y
6.22 % Reverse Convertible auf Actelion N	CHF	1'000.00	22.02.2016	22.02.2017	27 479 779		-	100.000	100.000	22.02.	0.000	Y
5.48 % Reverse Convertible auf Geberit N	CHF	1'000.00	22.02.2016	22.02.2017	27 479 780		-	100.000	100.000	22.02.	0.000	Y
11.06 % Reverse Convertible auf Julius Baer GrpN	CHF	1'000.00	22.02.2016	22.02.2017	27 479 782		-	100.000	100.000	22.02.	0.000	Y
5.41 % Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	22.02.2016	22.02.2017	27 479 767		-	100.000	100.000	22.02.	0.000	Y
9.03 % Reverse Convertible auf Adecco N	CHF	1'000.00	22.02.2016	22.02.2017	27 479 781		-	100.000	100.000	22.02.	0.000	Y
5.24 % Reverse Convertible auf Givaudan N	CHF	1'000.00	22.02.2016	22.02.2017	27 479 777		-	100.000	100.000	22.02.	0.000	Y
5.79 % Reverse Convertible auf SGS N	CHF	1'000.00	22.02.2016	22.02.2017	27 479 778		-	100.000	100.000	22.02.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
12 1/4 % Reverse Convertible auf LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	22.02.2016	22.02.2017	27 479 775		-	100.000	100.000	22.02.	0.000	Y
8.97 % Reverse Convertible auf The Swatch Grp	CHF	1'000.00	22.02.2016	22.02.2017	27 479 776		-	100.000	100.000	22.02.	0.000	Y
4.39 % Reverse Convertible auf Swisscom N	CHF	1'000.00	22.02.2016	22.02.2017	27 479 774		-	100.000	100.000	22.02.	0.000	Y
8.47 % Reverse Convertible auf Richemont N	CHF	1'000.00	22.02.2016	22.02.2017	27 479 770		-	100.000	100.000	22.02.	0.000	Y
9.2 % Reverse Convertible auf Zurich Insur Grp N	CHF	1'000.00	22.02.2016	22.02.2017	27 479 772		-	100.000	100.000	22.02.	0.000	Y
7.41 % Reverse Convertible auf ABB N	CHF	1'000.00	22.02.2016	22.02.2017	27 479 769		-	100.000	100.000	22.02.	0.000	Y
7.43 % Reverse Convertible auf Swiss Re N	CHF	1'000.00	22.02.2016	22.02.2017	27 479 771		-	100.000	100.000	22.02.	0.000	Y
4.59 % Reverse Convertible auf Nestle N	CHF	1'000.00	22.02.2016	22.02.2017	27 479 765		-	100.000	100.000	22.02.	0.000	Y
11.87 % Reverse Convertible auf UBS Group N	CHF	1'000.00	22.02.2016	22.02.2017	27 479 768		-	100.000	100.000	22.02.	0.000	Y
5.35 % Reverse Convertible auf Novartis N	CHF	1'000.00	22.02.2016	22.02.2017	27 479 766		-	100.000	100.000	22.02.	0.000	Y
14.33 % Reverse Convertible auf CS Group N	CHF	1'000.00	22.02.2016	22.02.2017	27 479 773		-	100.000	100.000	22.02.	0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	23.02.2015	23.02.2017	24 204 088		-	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes	USD	1'000.00	23.02.2015	23.02.2017	24 204 091		-	98.220	100.000		0.000	Y
5.6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.02.2015	23.02.2017	26 670 495		-	100.000	100.000	23.02.	0.000	N
Express Certificate auf Aktien	USD	1'000.00	24.02.2014	24.02.2017	22 551 278		-	97.670	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	USD	1'000.00	24.02.2015	24.02.2017	24 204 105		-	98.150	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	EUR	1'000.00	27.02.2015	27.02.2017	24 204 130		-	99.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	27.02.2015	27.02.2017	24 204 110		-	98.190	100.000		0.000	Y
7.4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.02.2015	27.02.2017	26 670 546		-	100.000	100.000	27.02.	0.000	N
7.8 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	27.02.2015	27.02.2017	26 670 548		-	100.000	100.000	27.02.	0.34684	N
7.3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.03.2016	01.03.2017	30 179 795		-	100.000	100.000	01.03.	0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	03.03.2015	03.03.2017	26 670 621		-	98.200	100.000		0.000	Y
Outperformance Bonus Certificate auf Fresenius	EUR	1'000.00	06.03.2014	06.03.2017	23 403 282		-	98.190	100.000		0.000	Y
6.4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.03.2015	06.03.2017	26 670 537		-	100.000	100.000	06.03.	0.000	N
Underlying Tracker auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	06.03.2015	06.03.2017	26 670 631		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	06.03.2015	06.03.2017	24 204 162		-	98.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.03.2015	09.03.2017	26 670 666		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Rohstoffe	USD	1'000.00	10.03.2015	10.03.2017	26 670 683		-	98.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	13.03.2015	13.03.2017	24 204 183		-	98.220	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	13.03.2015	13.03.2017	26 670 673		-	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.03.2015	13.03.2017	26 670 652		-	100.000	100.000	13.03.	0.000	N
7 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.03.2016	15.03.2017	30 179 838		-	100.000	100.000	15.03.	0.000	Y
CPC with Participation auf USD/RUB	USD	1'000.00	27.03.2014	27.03.2017	23 403 359		-	96.090	99.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	27.03.2015	27.03.2017	27 480 174		-	99.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	07.04.2015	07.04.2017	27 480 166		-	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate auf Aktien	EUR	1'000.00	27.03.2014	10.04.2017	23 403 353		-	98.020	100.000		0.000	Y
9.72 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	10.04.2015	10.04.2017	24 204 285		-	100.000	100.000	06.01. 10.04.	0.21443 0.21369	N
Reverse Convertible auf Basket	EUR	1'000.00	10.04.2015	10.04.2017	27 480 253		-	99.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	04.08.2015	11.04.2017	28 154 631		-	99.850	100.000		0.000	Y
Outperformance Bonus Certificate auf ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	14.04.2014	14.04.2017	23 902 504		-	97.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Volkswagen Vz	EUR	1'000.00	14.04.2015	14.04.2017	24 204 293		-	99.820	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Indizes 12.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	17.04.2015	17.04.2017	23 403 150		-	100.000	100.000	12.01.	0.000	N
4.8 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	17.04.2015	17.04.2017	24 204 299		-	100.000	100.000	17.04.	0.000	N
12 % Reverse Convertible auf Twitter	CHF	1'000.00	20.04.2016	20.04.2017	31 727 380		-	100.000	100.000	20.04.	0.000	Y
10 1/2 % Reverse Convertible auf Netflix	USD	1'000.00	20.04.2016	20.04.2017	31 727 387		-	100.000	100.000	20.04.	7.260	Y
6 % Reverse Convertible auf Actelion N	CHF	1'000.00	20.04.2016	20.04.2017	31 727 383		-	100.000	100.000	20.04.	0.000	Y
11 % Reverse Convertible auf Tesla Motors	USD	1'000.00	20.04.2016	20.04.2017	31 727 386		-	100.000	100.000	20.04.	7.260	Y
10 1/2 % Reverse Convertible auf ArcelorMittal Reg	EUR	1'000.00	20.04.2016	20.04.2017	31 727 385		-	100.000	100.000	20.04.	0.000	Y
12 % Reverse Convertible auf Repsol	EUR	1'000.00	20.04.2016	20.04.2017	31 727 384		-	100.000	100.000	20.04.	0.000	Y
11 % Reverse Convertible auf Glencore	CHF	1'000.00	20.04.2016	20.04.2017	31 727 381		-	100.000	100.000	20.04.	0.000	Y
8 % Reverse Convertible auf CS Group N	CHF	1'000.00	20.04.2016	20.04.2017	31 727 382		-	100.000	100.000	20.04.	0.000	Y
7.2 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	24.04.2015	24.04.2017	27 480 280		-	100.000	100.000	23.01. 24.04.	0.18781 0.18923	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	24.04.2015	24.04.2017	27 480 259		-	100.000	100.000		0.000	Y
6 1/2 % Reverse Convertible auf Zurich Insur Grp N	CHF	1'000.00	27.04.2016	27.04.2017	31 727 409		-	100.000	100.000	27.04.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
7 1/2 % Reverse Convertible auf Bayer N	EUR	1'000.00	27.04.2016	27.04.2017	31 727 412		-	100.000	100.000	27.04.	0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	27.04.2016	27.04.2017	31 727 410		-	100.000	100.000	27.04.	0.000	Y
10 1/4 % Reverse Convertible auf Deutsche Bank N	EUR	1'000.00	27.04.2016	27.04.2017	31 727 411		-	100.000	100.000	27.04.	0.000	Y
9 % Reverse Convertible auf Noble Energy	USD	1'000.00	27.04.2016	27.04.2017	31 727 413		-	100.000	100.000	27.04.	7.360	Y
7 % Reverse Convertible auf Facebook-A	USD	1'000.00	27.04.2016	27.04.2017	31 727 414		-	100.000	100.000	27.04.	7.360	Y
15 % Reverse Convertible auf US Steel	CHF	1'000.00	27.04.2016	27.04.2017	31 727 408		-	100.000	100.000	27.04.	0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	04.05.2015	04.05.2017	27 480 307		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.05.2015	04.05.2017	27 480 329		-	100.000	100.000		0.000	Y
3.36 % Reverse Convertible auf Nestle N	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.05.2017	27 479 800		-	100.000	100.000	04.05.	0.000	Y
8.09 % Reverse Convertible auf Aktien	AUD	1'000.00	04.05.2016	04.05.2017	27 479 814		-	100.000	100.000	04.05.	15.020	Y
6.15 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	04.05.2016	04.05.2017	27 479 813		-	100.000	100.000	04.05.	0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	04.05.2016	04.05.2017	27 479 812		-	100.000	100.000	04.05.	7.820	Y
6.12 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.05.2017	27 479 810		-	100.000	100.000	04.05.	0.000	Y
4.55 % Reverse Convertible auf Geberit N	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.05.2017	27 479 796		-	100.000	100.000	04.05.	0.000	Y
5.9 % Reverse Convertible auf ABB N	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.05.2017	27 479 792		-	100.000	100.000	04.05.	0.000	Y
7.65 % Reverse Convertible auf Actelion N	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.05.2017	27 479 793		-	100.000	100.000	04.05.	0.000	Y
9.19 % Reverse Convertible auf Adecco N	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.05.2017	27 479 794		-	100.000	100.000	04.05.	0.000	Y
12.16 % Reverse Convertible auf CS Group N	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.05.2017	27 479 795		-	100.000	100.000	04.05.	0.000	Y
8.89 % Reverse Convertible auf Julius Baer GrpN	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.05.2017	27 479 798		-	100.000	100.000	04.05.	0.000	Y
4.1 % Reverse Convertible auf Givaudan N	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.05.2017	27 479 797		-	100.000	100.000	04.05.	0.000	Y
10.52 % Reverse Convertible auf LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.05.2017	27 479 799		-	100.000	100.000	04.05.	0.000	Y
4.23 % Reverse Convertible auf Novartis N	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.05.2017	27 479 801		-	100.000	100.000	04.05.	0.000	Y
5.91 % Reverse Convertible auf Swiss Life HldgN	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.05.2017	27 479 804		-	100.000	100.000	04.05.	0.000	Y
7.96 % Reverse Convertible auf Richemont N	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.05.2017	27 479 802		-	100.000	100.000	04.05.	0.000	Y
8.23 % Reverse Convertible auf The Swatch Grp	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.05.2017	27 479 807		-	100.000	100.000	04.05.	0.000	Y
4.31 % Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.05.2017	27 479 803		-	100.000	100.000	04.05.	0.000	Y
4.69 % Reverse Convertible auf Swisscom N	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.05.2017	27 479 806		-	100.000	100.000	04.05.	0.000	Y
6.34 % Reverse Convertible auf Swiss Re N	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.05.2017	27 479 805		-	100.000	100.000	04.05.	0.000	Y
6.67 % Reverse Convertible auf Zurich Insur Grp N	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.05.2017	27 479 809		-	100.000	100.000	04.05.	0.000	Y
9.84 % Reverse Convertible auf UBS Group N	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.05.2017	27 479 808		-	100.000	100.000	04.05.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.05.2015	05.05.2017	27 480 317		-	100.000	100.000	27.01. 05.05.	0.000 0.000	N
7.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.05.2015	05.05.2017	27 480 333		-	100.000	100.000	02.02. 05.05.	0.000 0.000	N
9.2 % Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	05.05.2015	05.05.2017	27 480 319		-	100.000	100.000	27.01. 05.05.	1.821 1.803	N
6.78 % Reverse Convertible auf Aktien	GBP	1'000.00	05.05.2016	05.05.2017	27 479 811		-	100.000	100.000	05.05.	8.190	Y
Participation-Zert. auf Basket	EUR	1'000.00	06.11.2013	08.05.2017	22 551 082		-	97.410	100.000		0.000	Y
Bonus Outperformance-Zert. auf Equities	CHF	1'000.00	08.11.2013	08.05.2017	22 551 087		-	98.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	08.05.2015	08.05.2017	27 480 370		-	100.000	100.000		0.000	Y
7.8 % Reverse Convertible auf Aktien 7.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.05.2015	08.05.2017	27 480 349		-	100.000	100.000	07.02.	0.000	N
6 % Reverse Convertible auf Aktien 7.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.05.2015	08.05.2017	27 480 350		-	100.000	100.000	07.02.	0.000	N
7.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.05.2015	08.05.2017	24 204 380		-	100.000	100.000	08.05.	0.000	N
8 % Reverse Convertible auf Fiat Chrysler Auto	EUR	1'000.00	10.05.2016	10.05.2017	31 727 446		-	100.000	100.000	10.05.	0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Galenica N	CHF	1'000.00	10.05.2016	10.05.2017	31 727 444		-	100.000	100.000	10.05.	0.000	Y
5 1/2 % Reverse Convertible auf Exxon Mobil	USD	1'000.00	10.05.2016	10.05.2017	31 727 449		-	100.000	100.000	10.05.	7.560	Y
10 % Reverse Convertible auf Netflix	USD	1'000.00	10.05.2016	10.05.2017	31 727 448		-	100.000	100.000	10.05.	7.560	Y
5 % Reverse Convertible auf Swiss Re N	CHF	1'000.00	10.05.2016	10.05.2017	31 727 445		-	100.000	100.000	10.05.	0.000	Y
11 % Reverse Convertible auf Glencore	CHF	1'000.00	10.05.2016	10.05.2017	31 727 443		-	100.000	100.000	10.05.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5 % Reverse Convertible auf ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	10.05.2016	10.05.2017	31 727 447		-	100.000	100.000	10.05.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Aktien 9.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.05.2015	11.05.2017	24 204 381		-	100.000	100.000	09.02.	0.000	N
11 1/4 % (15 % p.a.) Reverse Convertible auf Crude Oil	USD	1'000.00	12.08.2016	12.05.2017	32 950 612		-	100.000	100.000	12.05.	9.170	Y
10.65 % (14.2 % p.a.) Reverse Convertible auf Crude Oil	CHF	1'000.00	12.08.2016	12.05.2017	32 950 611		-	100.000	100.000	12.05.	0.000	Y
Reverse Convertible auf Petroleo Br Sp ADR	USD	1'000.00	14.11.2014	15.05.2017	25 824 443		-	97.660	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Fonds	USD	1'000.00	15.05.2015	15.05.2017	24 204 396		-	98.260	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	EUR	1'000.00	15.05.2015	15.05.2017	27 480 371		-	99.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	USD	1'000.00	15.05.2015	15.05.2017	27 480 372		-	98.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Petroleo Br Sp ADR	USD	1'000.00	17.11.2014	17.05.2017	25 824 451		-	97.620	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	17.11.2014	17.05.2017	24 204 858		-	99.850	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	EUR	1'000.00	17.11.2015	17.05.2017	30 179 446		-	100.000	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	17.05.2016	17.05.2017	31 727 476		-	100.000	100.000	17.05.	7.240	Y
7 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.05.2016	17.05.2017	31 727 473		-	100.000	100.000	17.05.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	17.05.2016	17.05.2017	31 727 474		-	100.000	100.000	17.05.	0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.05.2015	18.05.2017	27 480 389		-	100.000	100.000	13.02. 18.05.	0.000 0.000	N
9 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.11.2015	18.05.2017	30 179 433		-	100.000	100.000	18.05.	0.000	N
2 1/2 % Protection Participation auf Aktien	USD	1'000.00	19.05.2015	19.05.2017	28 154 219		-	88.910	90.000	19.05.	2.430	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	22.05.2015	22.05.2017	28 154 216		-	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Bonus Certificate auf Aktien	CHF	5'000.00	24.02.2014	24.05.2017	23 403 236		-	99.420	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible called for Red. on 24.02.17 at 100% 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	24.11.2015	24.05.2017	30 179 412		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	N
8 % Reverse Convertible auf UBS Group N	CHF	1'000.00	24.05.2016	24.05.2017	31 727 498		-	100.000	100.000	24.05.	0.000	Y
14 % Reverse Convertible auf Petroleo Br Sp ADR	USD	1'000.00	24.05.2016	24.05.2017	31 727 503		-	100.000	100.000	24.05.	7.610	Y
7 % Reverse Convertible auf Volkswagen Vz	EUR	1'000.00	24.05.2016	24.05.2017	31 727 502		-	100.000	100.000	24.05.	0.000	Y
8 % Reverse Convertible auf Deutsche Bank N	EUR	1'000.00	24.05.2016	24.05.2017	31 727 501		-	100.000	100.000	24.05.	0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Zurich Insur Grp N	CHF	1'000.00	24.05.2016	24.05.2017	31 727 500		-	100.000	100.000	24.05.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Actelion N	CHF	1'000.00	24.05.2016	24.05.2017	31 727 499		-	100.000	100.000	24.05.	0.000	Y
8 % Reverse Convertible auf S&P GSCI Crd Oil ER	USD	1'000.00	24.05.2016	24.05.2017	31 727 504		-	100.000	100.000	24.05.	7.610	Y
Reverse Convertible auf Petroleo Br Sp ADR	USD	1'000.00	25.11.2014	26.05.2017	25 824 499		-	97.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Petroleo Br Sp ADR 21.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	27.03.2015	26.05.2017	27 480 172		-	97.770	100.000		0.000	Y
Bonus-Zert. auf basket	CHF	1'000.00	29.11.2013	29.05.2017	22 551 122		-	98.920	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	29.05.2015	29.05.2017	28 154 187		-	100.000	100.000	29.05.	1.091	N
6 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.05.2016	31.05.2017	31 727 532		-	100.000	100.000	31.05.	0.000	Y
10 % Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	31.05.2016	31.05.2017	31 727 534		-	100.000	100.000	31.05.	8.320	Y
6 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	31.05.2016	31.05.2017	31 727 533		-	100.000	100.000	31.05.	0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	USD	1'000.00	01.06.2015	01.06.2017	24 204 425		-	98.320	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Indizes 27.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung 27.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	01.06.2015	01.06.2017	28 154 227		-	100.000	100.000	27.02.	0.000	N
Worst of Bonus Certificate auf Aktien	CHF	5'000.00	06.12.2013	06.06.2017	22 551 134		-	99.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	08.12.2014	08.06.2017	26 105 188		-	99.930	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	08.06.2015	08.06.2017	28 154 252		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	EUR	1'000.00	08.06.2015	08.06.2017	28 154 253		-	99.800	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Apple	CHF	1'000.00	08.06.2016	08.06.2017	31 727 565		-	100.000	100.000	08.06.	0.000	Y
6 1/2 % Reverse Convertible auf Swiss Re N	CHF	1'000.00	08.06.2016	08.06.2017	31 727 566		-	100.000	100.000	08.06.	0.000	Y
8 % Reverse Convertible auf Deutsche Bank N	EUR	1'000.00	08.06.2016	08.06.2017	31 727 600		-	100.000	100.000	08.06.	0.000	Y
14 % Reverse Convertible auf Wght Wtcher Intl	CHF	1'000.00	08.06.2016	08.06.2017	31 727 563		-	100.000	100.000	08.06.	0.000	Y
6 1/2 % Reverse Convertible auf ABB N	CHF	1'000.00	08.06.2016	08.06.2017	31 727 567		-	100.000	100.000	08.06.	0.000	Y
7 1/2 % Reverse Convertible auf Galenica N	CHF	5'000.00	08.06.2016	08.06.2017	31 727 564		-	100.000	100.000	08.06.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
8 % Reverse Convertible auf Porsche AutoHldg Vz	EUR	1'000.00	08.06.2016	08.06.2017	31 727 569		-	100.000	100.000	08.06.	0.000	Y
5 1/2 % Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	08.06.2016	08.06.2017	31 727 568		-	100.000	100.000	08.06.	0.000	Y
12 1/2 % Reverse Convertible auf ArcelorMtl NY Reg	USD	1'000.00	08.06.2016	08.06.2017	31 727 570		-	100.000	100.000	08.06.	7.730	Y
7 1/2 % Reverse Convertible auf UBS Group N	CHF	1'000.00	08.06.2016	08.06.2017	31 727 599		-	100.000	100.000	08.06.	0.000	Y
8 % Reverse Convertible auf CS Group N	CHF	1'000.00	08.06.2016	08.06.2017	31 727 598		-	100.000	100.000	08.06.	0.000	Y
8 % Reverse Convertible auf Morgan Stanley	USD	1'000.00	08.06.2016	08.06.2017	31 727 601		-	100.000	100.000	08.06.	8.410	Y
10 % Reverse Convertible auf Banco Popolare	CHF	1'000.00	08.06.2016	08.06.2017	31 727 596		-	100.000	100.000	08.06.	0.000	Y
Underlying Tracker auf STXE6O&G EUR P	USD	1'000.00	12.12.2014	12.06.2017	26 105 291		-	97.370	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf iShs Glb Tech	USD	1'000.00	12.06.2015	12.06.2017	28 154 342		-	98.200	100.000		0.000	Y
Worst of Bonus Certificate auf Aktien	CHF	1'000.00	13.12.2013	13.06.2017	22 551 148		-	99.060	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	13.06.2016	13.06.2017	31 727 615		-	100.000	100.000	13.06.	0.000	Y
9 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.06.2016	13.06.2017	31 727 612		-	100.000	100.000	13.06.	0.000	Y
10 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.06.2016	13.06.2017	31 727 611		-	100.000	100.000	13.06.	0.000	Y
12 % Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	13.06.2016	13.06.2017	31 727 616		-	100.000	100.000	13.06.	7.740	Y
8 % Reverse Convertible auf Aktien 9.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	14.12.2015	14.06.2017	30 179 523		-	100.000	100.000	09.03.	0.000	N
5.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.06.2015	15.06.2017	28 154 297		-	100.000	100.000	09.03. 15.06.	0.000 0.000	N
7 % Reverse Convertible auf Aktien 9.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	15.06.2015	15.06.2017	28 154 295		-	100.000	100.000	09.03.	0.000	N
6.2 % Reverse Convertible auf Aktien 9.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	15.06.2015	15.06.2017	28 154 296		-	100.000	100.000	09.03.	0.000	N
Reverse Convertible auf Basket	EUR	1'000.00	16.06.2015	16.06.2017	28 154 352		-	99.760	100.000		0.000	Y
Best of Cert. on Basket	EUR	1'000.00	19.06.2013	19.06.2017	21 229 756		-	96.360	100.000		0.000	Y
7 % (3 1/2 % p.a.) Reverse Convertible auf ams 16.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.06.2015	19.06.2017	28 154 368		-	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Zurich Insur Grp N	CHF	1'000.00	21.06.2016	21.06.2017	31 727 654		-	100.000	100.000	21.06.	0.000	Y
7 1/2 % Reverse Convertible auf Actelion N	CHF	1'000.00	21.06.2016	21.06.2017	31 727 653		-	100.000	100.000	21.06.	0.000	Y
7 1/2 % Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	1'000.00	21.06.2016	21.06.2017	31 727 652		-	100.000	100.000	21.06.	0.000	Y
8 1/2 % Reverse Convertible auf LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	21.06.2016	21.06.2017	31 727 651		-	100.000	100.000	21.06.	0.000	Y
7 1/2 % Reverse Convertible auf Facebook-A	USD	1'000.00	21.06.2016	21.06.2017	31 727 656		-	100.000	100.000	21.06.	7.310	Y
8 % Reverse Convertible auf Volkswagen Vz	EUR	1'000.00	21.06.2016	21.06.2017	31 727 655		-	100.000	100.000	21.06.	0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	23.12.2015	23.06.2017	30 179 601		-	100.000	100.000		0.000	Y
16 1/2 % Reverse Convertible auf LendingClub	CHF	1'000.00	23.06.2016	23.06.2017	31 727 704		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
14 % Reverse Convertible auf GoPro-A	USD	1'000.00	23.06.2016	23.06.2017	31 727 709		-	100.000	100.000	23.06.	7.070	Y
6 % Reverse Convertible auf Apple	USD	1'000.00	23.06.2016	23.06.2017	31 727 710		-	100.000	100.000	23.06.	7.160	Y
10 % Reverse Convertible auf Tesla Motors	CHF	1'000.00	23.06.2016	23.06.2017	31 727 705		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf SAP	EUR	1'000.00	23.06.2016	23.06.2017	31 727 708		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
9 % Reverse Convertible auf Netflix	CHF	1'000.00	23.06.2016	23.06.2017	31 727 707		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	26.06.2015	26.06.2017	26 670 836		-	99.700	100.000		0.000	Y
6.9 % Underlying Tracker auf Aktien	USD	1'000.00	26.06.2015	26.06.2017	26 670 835		-	100.000	100.000	26.06.	17.270	Y
10 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	26.06.2015	26.06.2017	28 154 376		-	100.000	100.000	23.03.	0.40145	N
10 % Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	27.06.2016	27.06.2017	31 727 694		-	100.000	100.000	27.06.	7.330	Y
8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.06.2016	27.06.2017	31 727 689		-	100.000	100.000	27.06.	0.000	Y
20 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.06.2016	27.06.2017	31 727 688		-	100.000	100.000	27.06.	0.000	Y
6 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.06.2016	27.06.2017	31 727 690		-	100.000	100.000	27.06.	0.000	Y
8 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	27.06.2016	27.06.2017	31 727 693		-	100.000	100.000	27.06.	0.000	Y
Worst of Bonus Certificate auf Aktien	CHF	1'000.00	28.03.2014	28.06.2017	23 403 333		-	99.160	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	EUR	1'000.00	29.06.2015	29.06.2017	26 670 841		-	99.720	100.000		0.000	Y
14.8 % Reverse Convertible auf Aktien 23.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	29.03.2016	29.06.2017	31 727 310		-	100.000	100.000	23.03.	0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	30.12.2014	30.06.2017	26 105 332		-	99.980	100.000		0.000	Y
Kapitalschutz-Zert. auf Volality mit Kreditrisiko	USD	1'000.00	02.04.2014	05.07.2017	23 403 381		-	85.750	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible auf CyberArk Software	USD	1'000.00	29.06.2015	06.07.2017	26 670 845		-	98.210	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes	EUR	1'000.00	06.07.2015	06.07.2017	28 154 466		-	99.740	100.000		0.000	Y
8 1/2 % Reverse Convertible auf BMW	EUR	1'000.00	06.07.2016	06.07.2017	31 727 739		-	100.000	100.000	06.07.	0.000	Y
9 % Reverse Convertible auf CS Group N	CHF	1'000.00	06.07.2016	06.07.2017	31 727 735		-	100.000	100.000	06.07.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Richemont N	CHF	1'000.00	06.07.2016	06.07.2017	31 727 738		-	100.000	100.000	06.07.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	06.07.2016	06.07.2017	31 727 737		-	100.000	100.000	06.07.	0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Starbucks	USD	1'000.00	06.07.2016	06.07.2017	31 727 740		-	100.000	100.000	06.07.	6.350	Y
Worst of Bonus Certificate auf Aktien	CHF	1'000.00	10.01.2014	10.07.2017	22 551 201		-	98.680	100.000		0.000	Y
5 % Worst of Bonus Certificate with Coupon auf Aktien	CHF	1'000.00	10.04.2014	10.07.2017	23 403 356		-	100.000	100.000	10.01. 10.04. 10.07.	0.550 0.550 0.550	N
Underlying Tracker auf ESTX50 EUR P	EUR	3'729.00	10.04.2015	10.07.2017	27 480 235		-	99.730	100.000		0.000	Y
5.3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.07.2015	10.07.2017	28 154 477		-	100.000	100.000	10.07.	0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	10.07.2015	10.07.2017	28 154 457		-	100.000	100.000		0.000	Y
5 % StructuredNote mit Kreditrisiko auf LUKOIL OAO	USD	1'000.00	25.02.2015	11.07.2017	26 670 572		-	100.000	100.000	11.01. 11.04. 11.07.	13.079 12.577 12.374	N
Reverse Convertible auf GoPro-A	USD	1'000.00	03.07.2015	11.07.2017	26 670 854		-	98.180	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf US Steel 6.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.475%	USD	1'000.00	03.07.2015	11.07.2017	26 670 853		-	98.180	100.000		0.000	Y
9 % Reverse Convertible auf Aktien 6.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.07.2016	11.07.2017	31 727 781		-	100.000	100.000	06.01. 06.04.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Corn	USD	1'000.00	13.01.2015	13.07.2017	26 105 388		-	97.470	100.000		0.000	Y
8.24 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	13.07.2015	13.07.2017	27 479 462		-	99.500	100.000	11.01. 11.04. 13.07.	0.320 0.320 0.340	Y
Bonus Certificate auf Aktien	CHF	1'000.00	14.01.2014	14.07.2017	22 551 213		-	98.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes	USD	1'000.00	14.07.2015	14.07.2017	28 154 504		-	98.580	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	EUR	1'000.00	15.01.2015	17.07.2017	26 105 418		-	99.530	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	USD	1'000.00	15.01.2015	17.07.2017	26 105 419		-	97.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	17.07.2015	17.07.2017	28 154 512		-	98.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf The Swatch Grp	CHF	1'000.00	18.01.2016	18.07.2017	30 179 692		-	100.000	100.000		0.000	Y
8 1/2 % Reverse Convertible auf LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	19.07.2016	19.07.2017	32 950 435		-	100.000	100.000	19.07.	0.000	Y
8 % Reverse Convertible auf Morgan Stanley	USD	1'000.00	19.07.2016	19.07.2017	32 950 440		-	100.000	100.000	19.07.	7.150	Y
5 1/2 % Reverse Convertible auf Actelion N	CHF	1'000.00	19.07.2016	19.07.2017	32 950 438		-	100.000	100.000	19.07.	0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Adecco Group N	CHF	1'000.00	19.07.2016	19.07.2017	32 950 437		-	100.000	100.000	19.07.	0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf ThyssenKrupp	EUR	1'000.00	19.07.2016	19.07.2017	32 950 439		-	100.000	100.000	19.07.	0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	EUR	1'000.00	20.01.2015	20.07.2017	26 105 430		-	99.510	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	USD	1'000.00	20.01.2015	20.07.2017	26 105 429		-	97.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Daimler N	EUR	1'000.00	20.07.2015	20.07.2017	27 479 475		-	99.740	100.000		0.000	Y
7 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.07.2016	20.07.2017	31 727 796		-	100.000	100.000	20.07.	0.000	Y
8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.07.2016	20.07.2017	31 727 795		-	100.000	100.000	20.07.	0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	20.07.2016	20.07.2017	31 727 797		-	100.000	100.000	20.07.	0.000	Y
8 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	20.07.2016	20.07.2017	31 727 798		-	100.000	100.000	20.07.	7.130	Y
9 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.07.2016	20.07.2017	31 727 794		-	100.000	100.000	20.07.	0.000	Y
6.95 % Reverse Convertible auf Crude Oil	USD	1'000.00	20.07.2016	20.07.2017	27 479 859		-	100.000	100.000	20.07.	7.130	Y
4.81 % Reverse Convertible auf Crude Oil	CHF	1'000.00	20.07.2016	20.07.2017	27 479 857		-	100.000	100.000	20.07.	0.000	Y
10 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	20.07.2016	20.07.2017	31 727 793		-	100.000	100.000	20.07.	0.000	Y
5.36 % Reverse Convertible auf Crude Oil	EUR	1'000.00	20.07.2016	20.07.2017	27 479 858		-	100.000	100.000	20.07.	0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	USD	1'000.00	23.01.2015	24.07.2017	26 670 377		-	97.797	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Syngenta N	CHF	1'000.00	24.07.2015	24.07.2017	27 479 483		-	100.000	100.000		0.000	Y
4.6 % Reverse Convertible auf Indizes 20.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	24.07.2015	24.07.2017	28 154 522		-	100.000	100.000	20.01. 21.04.	0.32205 0.32023	N
10 % Reverse Convertible auf Aktien 20.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	25.04.2016	25.07.2017	31 727 402		-	100.000	100.000	20.01.	0.000	N
15 % Reverse Convertible auf Aktien 20.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	25.04.2016	25.07.2017	31 727 395		-	100.000	100.000	20.01.	0.000	N
Underlying Tracker auf Gold 1 Uz	USD	1'000.00	28.01.2015	28.07.2017	24 204 012		-	97.830	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Worst of Bonus Certificate auf Aktien	CHF	5'000.00	31.01.2014	31.07.2017	22 551 251		-	99.300	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.07.2015	31.07.2017	28 154 561		-	100.000	100.000	27.01. 27.04. 31.07.	0.000 0.000 0.000	N
6 % Reverse Convertible auf Aktien 27.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	31.07.2015	31.07.2017	28 154 562		-	100.000	100.000	27.01. 27.04.	0.29385 0.29723	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	31.07.2015	31.07.2017	28 154 574		-	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Crude Oil	USD	1'000.00	03.08.2016	03.08.2017	32 950 513		-	100.000	100.000	03.08.	8.420	Y
10 % Reverse Convertible auf Netflix	USD	1'000.00	03.08.2016	03.08.2017	32 950 512		-	100.000	100.000	03.08.	8.420	Y
4 1/2 % Reverse Convertible auf Novartis N	CHF	1'000.00	03.08.2016	03.08.2017	32 950 509		-	100.000	100.000	03.08.	0.000	Y
4 3/4 % Reverse Convertible auf Galenica N	CHF	5'000.00	03.08.2016	03.08.2017	32 950 508		-	100.000	100.000	03.08.	0.000	Y
8 % Reverse Convertible auf Volkswagen Vz	EUR	1'000.00	03.08.2016	03.08.2017	32 950 511		-	100.000	100.000	03.08.	0.000	Y
Underlying Tracker auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	04.08.2015	04.08.2017	27 479 516		-	100.000	100.000		0.000	Y
12 % Reverse Convertible auf Aktien 27.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.08.2017	31 727 429		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	N
12.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	04.05.2016	04.08.2017	31 727 428		-	100.000	100.000	27.01. 27.04. 04.08.	0.000 0.000 0.000	N
22 % Reverse Convertible auf Aktien 27.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.08.2017	31 727 426		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	N
5.2 % Reverse Convertible auf Aktien 4.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	07.08.2015	07.08.2017	28 154 610		-	100.000	100.000	02.02. 04.05.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	09.02.2015	09.08.2017	26 670 417		-	100.000	100.000		0.000	Y
11 % Reverse Convertible auf Aktien 2.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	09.05.2016	09.08.2017	31 727 462		-	100.000	100.000	02.02.	0.000	N
10.6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	09.05.2016	09.08.2017	31 727 463		-	100.000	100.000	02.02. 04.05. 09.08.	0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	11.02.2015	11.08.2017	26 670 437		-	100.000	100.000		0.000	Y
8 % (4 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.08.2015	14.08.2017	28 154 634		-	100.000	100.000	14.08.	0.000	Y
5.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.08.2015	14.08.2017	28 154 642		-	100.000	100.000	10.02. 11.05. 14.08.	0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	14.08.2015	14.08.2017	28 154 697		-	99.780	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	16.08.2016	16.08.2017	32 950 582		-	100.000	100.000	16.08.	0.000	Y
8 % Reverse Convertible auf Societe Generale	EUR	1'000.00	16.08.2016	16.08.2017	32 950 584		-	100.000	100.000	16.08.	0.000	Y
12 % Reverse Convertible auf Freeport McMoRan	CHF	1'000.00	16.08.2016	16.08.2017	32 950 577		-	100.000	100.000	16.08.	0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Adecco Group N	CHF	1'000.00	16.08.2016	16.08.2017	32 950 580		-	100.000	100.000	16.08.	0.000	Y
8 % Reverse Convertible auf Twitter	CHF	1'000.00	16.08.2016	16.08.2017	32 950 578		-	100.000	100.000	16.08.	0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Apple	USD	1'000.00	16.08.2016	16.08.2017	32 950 585		-	100.000	100.000	16.08.	9.070	Y
6 % Reverse Convertible auf Alphabet-A	USD	1'000.00	16.08.2016	16.08.2017	32 950 586		-	100.000	100.000	16.08.	9.070	Y
6 % Reverse Convertible auf STXE6Bnk EUR P	CHF	1'000.00	16.08.2016	16.08.2017	32 950 581		-	100.000	100.000	16.08.	0.000	Y
9 % Reverse Convertible auf Fiat Chrysler Auto	EUR	1'000.00	16.08.2016	16.08.2017	32 950 583		-	100.000	100.000	16.08.	0.000	Y
7 1/2 % Reverse Convertible auf Zurich Insur Grp N	CHF	1'000.00	16.08.2016	16.08.2017	32 950 579		-	100.000	100.000	16.08.	0.000	Y
10.8 % Reverse Convertible auf Aktien 10.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	17.05.2016	17.08.2017	31 727 489		-	100.000	100.000	10.02.	0.000	N
10 % Reverse Convertible auf Aktien 15.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	17.08.2016	17.08.2017	32 950 614		-	100.000	100.000	15.02. 15.05.	0.000 0.000	N
6 % Reverse Convertible auf Aktien 18.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	21.08.2015	21.08.2017	28 154 684		-	100.000	100.000	17.02. 18.05.	0.23941 0.24494	N
5.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.08.2015	24.08.2017	28 154 700		-	100.000	100.000	22.02. 22.05. 24.08.	0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	27.02.2015	25.08.2017	26 670 532		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	USD	1'000.00	27.02.2015	25.08.2017	26 670 533		-	97.310	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.2 % Reverse Convertible auf Aktien 26.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	28.08.2015	28.08.2017	28 154 722		-	100.000	100.000	24.02. 26.05.	0.000 0.000	N
5.12 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.08.2015	28.08.2017	27 479 573		-	100.000	100.000	24.02. 26.05. 28.08.	0.000 0.000 0.000	N
4.92 % Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	29.08.2016	29.08.2017	27 479 871		-	100.000	100.000	29.08.	0.000	Y
3.56 % Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	29.08.2016	29.08.2017	27 479 872		-	100.000	100.000	29.08.	0.000	Y
6.07 % Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	29.08.2016	29.08.2017	27 479 873		-	100.000	100.000	29.08.	0.000	Y
4.29 % Reverse Convertible auf Swisscom N	CHF	1'000.00	29.08.2016	29.08.2017	27 479 874		-	100.000	100.000	29.08.	0.000	Y
5.58 % Reverse Convertible auf Swisscom N	CHF	1'000.00	29.08.2016	29.08.2017	27 479 875		-	100.000	100.000	29.08.	0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.08.2016	29.08.2017	32 950 667		-	100.000	100.000	29.08.	0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	EUR	1'000.00	03.03.2015	31.08.2017	26 670 622		-	99.700	100.000		0.000	Y
6 1/2 % Reverse Convertible auf Zurich Insur Grp N	CHF	1'000.00	31.08.2016	31.08.2017	32 950 649		-	100.000	100.000	31.08.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Actelion N	CHF	1'000.00	31.08.2016	31.08.2017	32 950 650		-	100.000	100.000	31.08.	0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	31.08.2016	31.08.2017	32 950 648		-	100.000	100.000	31.08.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Facebook-A	CHF	1'000.00	31.08.2016	31.08.2017	32 950 651		-	100.000	100.000	31.08.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf OC Oerlikon N	CHF	1'000.00	31.08.2016	31.08.2017	32 950 652		-	100.000	100.000	31.08.	0.000	Y
8 1/2 % Reverse Convertible auf Amazon.Com	USD	1'000.00	31.08.2016	31.08.2017	32 950 655		-	100.000	100.000	31.08.	8.640	Y
9 % Reverse Convertible auf Tesla Motors	USD	1'000.00	31.08.2016	31.08.2017	32 950 654		-	100.000	100.000	31.08.	8.740	Y
5 % Reverse Convertible auf Aktien 1.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	04.09.2015	04.09.2017	28 154 755		-	100.000	100.000	03.03. 01.06.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.09.2016	05.09.2017	32 950 713		-	100.000	100.000	05.09.	0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Aktien 8.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.03.2015	06.09.2017	26 670 582		-	100.000	100.000	07.03. 08.06.	0.000 0.000	N
14.2 % Reverse Convertible auf Aktien 3.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.06.2016	06.09.2017	31 727 585		-	100.000	100.000	03.03.	0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	06.09.2016	06.09.2017	32 950 714		-	100.000	100.000	06.09.	8.870	Y
9 1/2 % Reverse Convertible auf CS Group N	CHF	1'000.00	07.09.2016	07.09.2017	32 950 722		-	100.000	100.000	07.09.	0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Alphabet-A	USD	1'000.00	07.09.2016	07.09.2017	32 950 729		-	100.000	100.000	07.09.	9.050	Y
9 % Reverse Convertible auf Netflix	USD	1'000.00	07.09.2016	07.09.2017	32 950 728		-	100.000	100.000	07.09.	9.050	Y
7 1/2 % Reverse Convertible auf Bayer N	EUR	1'000.00	07.09.2016	07.09.2017	32 950 727		-	100.000	100.000	07.09.	0.000	Y
5 1/4 % Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	07.09.2016	07.09.2017	32 950 725		-	100.000	100.000	07.09.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Galenica N	CHF	5'000.00	07.09.2016	07.09.2017	32 950 724		-	100.000	100.000	07.09.	0.000	Y
8 % Reverse Convertible auf Fiat Chrysler Auto	EUR	1'000.00	07.09.2016	07.09.2017	32 950 726		-	100.000	100.000	07.09.	0.000	Y
13 % Reverse Convertible auf US Steel	CHF	1'000.00	07.09.2016	07.09.2017	32 950 721		-	100.000	100.000	07.09.	0.000	Y
7 3/4 % Reverse Convertible auf The Swatch Grp	CHF	1'000.00	07.09.2016	07.09.2017	32 950 723		-	100.000	100.000	07.09.	0.000	Y
Underlying Tracker auf SMI	CHF	1'000.00	10.09.2014	08.09.2017	24 204 547		-	99.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 5.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.737%	USD	1'000.00	08.09.2015	08.09.2017	28 154 801		-	98.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.09.2016	08.09.2017	32 950 716		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.09.2015	11.09.2017	28 154 813		-	100.000	100.000		0.000	Y
3 1/4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.09.2015	11.09.2017	28 154 779		-	100.000	100.000	11.09.	0.000	N
6.2 % Reverse Convertible auf Aktien 9.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.09.2015	11.09.2017	28 154 788		-	100.000	100.000	09.03. 09.06.	0.000 0.000	N
5.6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.09.2015	11.09.2017	28 154 775		-	100.000	100.000	09.03. 09.06. 11.09.	0.000 0.000 0.000	N
6.4 % Reverse Convertible auf Aktien 9.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung 9.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.09.2015	11.09.2017	28 154 787		-	100.000	100.000	09.03. 09.06.	0.000 0.000	N

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5 % Reverse Convertible auf Aktien 9.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.09.2015	11.09.2017	28 154 776		-	100.000	100.000	09.03. 09.06.	0.000 0.000	N
Worst of Bonus Certificate auf Aktien	CHF	1'000.00	12.09.2014	12.09.2017	24 204 539		-	99.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.03.2015	12.09.2017	24 204 192		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Indizes	CHF	1'000.00	13.03.2015	13.09.2017	26 670 716		-	100.000	100.000		0.000	Y
18 % Reverse Convertible auf Aktien 8.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	13.06.2016	13.09.2017	31 727 635		-	100.000	100.000	09.03. 08.06.	2.257 2.151	N
10 % Reverse Convertible auf Aktien 9.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	13.06.2016	13.09.2017	31 727 632		-	100.000	100.000	09.03.	0.000	N
7.1 % Reverse Convertible auf LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	13.09.2016	13.09.2017	33 705 476		-	100.000	100.000	13.09.	0.000	Y
7.3 % Reverse Convertible auf Apple	USD	1'000.00	13.09.2016	13.09.2017	33 705 481		-	100.000	100.000	13.09.	9.150	Y
5.3 % Reverse Convertible auf ABB N	CHF	1'000.00	13.09.2016	13.09.2017	33 705 477		-	100.000	100.000	13.09.	0.000	Y
6.9 % Reverse Convertible auf Daimler N	EUR	1'000.00	13.09.2016	13.09.2017	33 705 479		-	100.000	100.000	13.09.	0.000	Y
7.2 % Reverse Convertible auf Adecco Group N	CHF	1'000.00	13.09.2016	13.09.2017	33 705 475		-	100.000	100.000	13.09.	0.000	Y
8 % Reverse Convertible auf Bca Pop. Milano	EUR	1'000.00	13.09.2016	13.09.2017	33 705 478		-	100.000	100.000	13.09.	0.000	Y
9 % Reverse Convertible auf Twitter	CHF	1'000.00	13.09.2016	13.09.2017	33 705 474		-	100.000	100.000	13.09.	0.000	Y
9 % Reverse Convertible auf Tesla Motors	USD	1'000.00	13.09.2016	13.09.2017	33 705 480		-	100.000	100.000	13.09.	9.150	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.09.2016	15.09.2017	33 705 473		-	100.000	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible auf Aktien 16.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.03.2015	18.09.2017	24 204 203		-	100.000	100.000	16.03.	0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.03.2015	18.09.2017	24 204 206		-	100.000	100.000		0.000	Y
6.4 % Reverse Convertible auf Aktien 16.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	18.09.2015	18.09.2017	28 154 822		-	100.000	100.000	16.03.	0.21374	N
6.2 % Reverse Convertible auf Aktien 15.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung 15.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.09.2015	18.09.2017	28 154 821		-	100.000	100.000	16.03. 15.06.	0.000 0.000	N
6.4 % Reverse Convertible auf Aktien 16.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.09.2015	18.09.2017	28 154 820		-	100.000	100.000	16.03.	0.000	N
7 % Reverse Convertible auf Aktien 16.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.09.2015	18.09.2017	28 154 819		-	100.000	100.000	16.03.	0.000	N
3 % Reverse Convertible auf Indizes 16.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	20.03.2015	20.09.2017	26 670 694		-	100.000	100.000	16.03.	0.000	N
5 % Reverse Convertible auf Aktien 16.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	20.03.2015	20.09.2017	26 670 700		-	100.000	100.000	16.03. 16.06.	0.000 0.000	N
3.6 % Reverse Convertible auf Indizes 16.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	20.03.2015	20.09.2017	26 670 695		-	100.000	100.000	16.03.	0.34732	N
7 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.03.2015	20.09.2017	26 670 698		-	100.000	100.000	16.03. 16.06. 20.09.	0.000 0.000 0.000	N
8 % Reverse Convertible auf Air France - KLM	EUR	1'000.00	20.09.2016	20.09.2017	33 705 509		-	100.000	100.000	20.09.	0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	20.09.2016	20.09.2017	33 705 507		-	100.000	100.000	20.09.	0.000	Y
9 % Reverse Convertible auf ThyssenKrupp	EUR	1'000.00	20.09.2016	20.09.2017	33 705 508		-	100.000	100.000	20.09.	0.000	Y
20 % Reverse Convertible auf Valeant Pharma Intl	CHF	1'000.00	20.09.2016	20.09.2017	33 705 503		-	100.000	100.000	20.09.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Zurich Insur Grp N	CHF	1'000.00	20.09.2016	20.09.2017	33 705 506		-	100.000	100.000	20.09.	0.000	Y
7 1/2 % Reverse Convertible auf UBS Group N	CHF	1'000.00	20.09.2016	20.09.2017	33 705 504		-	100.000	100.000	20.09.	0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Actelion N	CHF	1'000.00	20.09.2016	20.09.2017	33 705 505		-	100.000	100.000	20.09.	0.000	Y
10 % Reverse Convertible auf Netflix	USD	1'000.00	20.09.2016	20.09.2017	33 705 510		-	100.000	100.000	20.09.	9.040	Y
5 % Reverse Convertible auf Alphabet-A	USD	1'000.00	20.09.2016	20.09.2017	33 705 511		-	100.000	100.000	20.09.	9.040	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	25.09.2014	25.09.2017	24 204 561		-	99.850	100.000		0.000	Y
7.8 % Reverse Convertible Called for red.on 23.06.17 at 100% 23.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.03.2015	27.09.2017	26 670 743		-	100.000	100.000	23.03. 23.06.	0.2944 0.29838	N
5.6 % Reverse Convertible auf Aktien 23.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	27.03.2015	27.09.2017	26 670 742		-	100.000	100.000	23.03. 23.06.	0.000 0.000	N

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible auf Aktien 30.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	03.10.2014	03.10.2017	24 204 596		-	99.820	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Rohstoffe	USD	1'000.00	05.10.2015	05.10.2017	28 154 888		-	100.000	100.000	30.03. 29.06. 05.10.	1.967 1.889 1.931	N
5.2 % Reverse Convertible auf Aktien 30.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	10.04.2015	10.10.2017	27 480 155		-	100.000	100.000	30.03. 30.06.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Tesla Motors 6.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.04.2016	11.10.2017	31 727 343		-	100.000	100.000		0.000	Y
14 % Reverse Convertible auf Aktien 6.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.10.2016	11.10.2017	33 705 585		-	100.000	100.000	06.01. 06.04.	0.000 0.000	N
7.4 % Reverse Convertible Called for red.on 06.07.17 at 100% 6.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	12.10.2015	12.10.2017	28 154 918		-	100.000	100.000	06.01. 06.04. 06.07.	0.000 0.000 0.000	N
Bonus outperformanc-Zert. auf Equities	EUR	1'000.00	16.10.2013	16.10.2017	21 820 640		-	95.910	100.000		0.000	Y
Bonus Outperformance-Zert. auf Equities	EUR	1'000.00	16.10.2013	16.10.2017	21 820 639		-	95.910	100.000		0.000	Y
Bonus Outperformance-Zert. auf Basket	EUR	1'000.00	17.10.2013	17.10.2017	21 820 644		-	95.870	100.000		0.000	Y
4 1/2 % Reverse Convertible auf Rohstoffe	CHF	1'000.00	17.10.2014	17.10.2017	24 204 599		-	100.000	100.000	17.10.	0.60666	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	17.04.2015	17.10.2017	27 480 230		-	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.10.2014	23.10.2017	24 204 612		-	100.000	100.000	23.10.	0.400	N
Reverse Convertible auf The Swatch Grp	CHF	1'000.00	25.04.2016	25.10.2017	31 727 441		-	100.000	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible auf Aktien 19.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	25.07.2016	25.10.2017	32 950 494		-	100.000	100.000	19.01.	0.000	N
10 % Reverse Convertible auf Aktien 20.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	25.07.2016	25.10.2017	32 950 493		-	100.000	100.000	19.01. 21.04. 20.07.	0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.10.2015	26.10.2017	27 479 635		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Daxk	EUR	1'000.00	27.10.2014	27.10.2017	24 204 688		-	99.220	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	27.10.2014	27.10.2017	24 204 657		-	99.250	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	USD	1'000.00	27.10.2014	27.10.2017	24 204 656		-	96.920	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	30.04.2015	30.10.2017	24 204 342		-	99.800	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	30.10.2015	30.10.2017	28 154 999		-	100.000	100.000	26.01. 27.04. 27.07. 30.10.	0.08007 0.08106 0.08427 0.08694	N
5.2 % Reverse Convertible auf Aktien 27.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.10.2015	30.10.2017	27 479 642		-	100.000	100.000	26.01. 27.04.	0.000 0.000	N
19 % Reverse Convertible auf Aktien 27.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	02.08.2016	02.11.2017	32 950 530		-	100.000	100.000	26.01. 27.04. 27.07.	0.000 0.000 0.000	N
10 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien 27.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	02.08.2016	02.11.2017	32 950 533		-	100.000	100.000	26.01. 27.04.	0.000 0.000	N
24 % Reverse Convertible auf Aktien 4.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.11.2016	07.11.2017	33 705 679		-	100.000	100.000	02.02. 04.05. 04.08.	0.000 0.000 0.000	N
4.5 % Reverse Convertible auf Basket	EUR	1'000.00	09.11.2015	09.11.2017	30 179 405		-	100.000	100.000	09.11.	1.050	N
21 % (6.92 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	30.10.2014	13.11.2017	24 204 698		-	100.000	100.000	13.11.	28.460	Y
Structured Note	USD	1'000.00	13.11.2014	13.11.2017	25 824 428		-	96.630	100.000		0.000	Y
9 % Reverse Convertible auf Aktien 11.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	13.11.2015	13.11.2017	30 179 388		-	100.000	100.000	09.02. 11.05.	2.076 2.089	N
5.6 % Reverse Convertible auf Aktien 11.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	13.11.2015	13.11.2017	28 155 055		-	100.000	100.000	09.02. 11.05.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	15.05.2015	15.11.2017	27 480 377		-	100.000	100.000		0.000	Y
9.6 % Reverse Convertible auf Aktien 11.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	15.08.2016	15.11.2017	32 950 607		-	100.000	100.000	09.02. 11.05.	0.000 0.000	N

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
8 % Reverse Convertible auf Aktien 15.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	10'000.00	17.08.2016	17.11.2017	32 950 615		-	100.000	100.000	15.02. 15.05.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	USD	1'000.00	20.05.2015	20.11.2017	24 204 412		-	97.540	100.000		0.000	Y
7.08 % Reverse Convertible auf Aktien 18.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	20.05.2015	20.11.2017	24 204 406		-	100.000	100.000	16.02. 18.05.	0.000 0.000	N
9.4 % Reverse Convertible auf Aktien 16.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	22.08.2016	22.11.2017	32 950 635		-	100.000	100.000	16.02.	0.000	N
24.5 % Reverse Convertible auf Aktien 18.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	22.08.2016	22.11.2017	27 479 866		-	100.000	100.000	21.02. 18.05.	2.271 2.201	N
5 % Reverse Convertible auf Indizes 26.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.02.2017	27.11.2017	27 479 984		-	100.000	100.000	26.05.	0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien 27.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.12%	USD	1'000.00	28.11.2014	28.11.2017	23 403 475		-	96.630	100.000		0.000	Y
9 % Reverse Convertible auf Aktien 26.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	29.08.2016	29.11.2017	32 950 680		-	100.000	100.000	23.02. 26.05.	0.000 0.000	N
14 % Reverse Convertible auf Aktien 26.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	29.08.2016	29.11.2017	32 950 675		-	100.000	100.000	24.02. 26.05.	0.000 0.000	N
10.2 % Reverse Convertible auf Aktien 26.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	29.08.2016	29.11.2017	32 950 677		-	100.000	100.000	23.02. 26.05.	0.000 0.000	N
15.6 % Reverse Convertible auf Aktien 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	29.08.2016	29.11.2017	32 950 682		-	100.000	100.000	24.02.	2.315	N
6.6 % Reverse Convertible auf Aktien 25.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	30.11.2015	30.11.2017	30 179 458		-	100.000	100.000	23.02. 25.05.	0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	04.12.2014	04.12.2017	25 824 459		-	100.000	100.000	04.12.	0.40222	N
9 % Reverse Convertible auf Aktien 2.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	10'000.00	06.09.2016	06.12.2017	32 950 709		-	100.000	100.000	02.03.	0.000	N
Underlying Tracker auf Apple	USD	1'000.00	13.11.2014	07.12.2017	25 824 435		-	96.470	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Rohstoffe	CHF	1'000.00	08.12.2015	08.12.2017	30 179 477		-	100.000	100.000	06.03. 07.06. 06.09. 08.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
17.8 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	14.12.2016	14.12.2017	27 479 954		-	100.000	100.000	12.01. 10.02. 10.03. 12.04. 11.05. 12.06. 12.07. 10.08. 12.09. 12.10. 10.11. 14.12.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
10.45 % (12.25 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.02.2017	14.12.2017	27 479 983		-	100.000	100.000	14.12.	0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	17.12.2014	18.12.2017	24 203 915		-	99.910	100.000		0.000	Y
8.8 % Reverse Convertible auf Rohstoffe 15.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	18.12.2015	18.12.2017	30 179 537		-	100.000	100.000	16.03. 15.06.	2.538 2.485	N
5.8 % Reverse Convertible auf Aktien 15.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.12.2015	18.12.2017	30 179 551		-	100.000	100.000	16.03. 15.06.	0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible auf Aktien 15.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.06.2015	19.12.2017	28 154 327		-	100.000	100.000	16.03. 15.06.	0.000 0.000	N
4 % Reverse Convertible auf Indizes 15.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.06.2015	19.12.2017	28 154 328		-	100.000	100.000	16.03. 15.06.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien 27.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	12.12.2014	27.12.2017	25 609 259		-	99.180	100.000		0.000	Y
18 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.06.2017	27.12.2017	36 663 464		-	100.000	100.000	27.09. 27.12.	0.000 0.000	N

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
12.7 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.06.2017	27.12.2017	36 663 465		-	100.000	100.000	27.09. 27.12.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Ford Motor	USD	1'000.00	29.12.2014	29.12.2017	24 203 926		-	96.370	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible auf Aktien 23.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	29.12.2015	29.12.2017	30 179 584		-	100.000	100.000	23.03.	2.580	N
6.2 % Reverse Convertible auf Aktien 22.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	29.12.2015	29.12.2017	30 179 582		-	100.000	100.000	23.03. 22.06.	0.000 0.000	N
7.8 % Reverse Convertible auf Aktien 22.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	29.12.2015	29.12.2017	30 179 583		-	100.000	100.000	23.03. 22.06.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	18.11.2016	29.12.2017	27 479 936		-	100.000	100.000		0.000	Y
5.2 % Reverse Convertible auf Rohstoffe 4.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.01.2016	08.01.2018	30 179 616		-	100.000	100.000	04.01. 03.04. 04.07. 04.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien 8.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.961%	EUR	1'000.00	10.07.2015	10.01.2018	27 479 458		-	99.580	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 11.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.651%	USD	1'000.00	12.01.2015	12.01.2018	24 203 943		-	96.370	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	16.01.2015	16.01.2018	26 105 374	%	84.450	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 12.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.81%	USD	1'000.00	16.01.2015	16.01.2018	26 105 428		-	96.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf The Swatch Grp	CHF	1'000.00	18.01.2016	18.01.2018	27 479 752	%	132.540	100.000	100.000		0.000	Y
11.2 % Reverse Convertible auf Aktien 12.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	19.07.2016	19.01.2018	32 950 462		-	100.000	100.000	12.01.	0.000	N
Reverse Convertible auf The Swatch Grp	CHF	1'000.00	22.01.2016	22.01.2018	27 479 759	%	133.030	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf The Swatch Grp	CHF	1'000.00	22.01.2016	22.01.2018	27 479 758	%	133.100	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	23.01.2015	23.01.2018	26 105 400	%	224.530	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Aktien 19.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	25.01.2016	25.01.2018	30 179 673		-	100.000	100.000	19.01.	0.000	N
5 % Reverse Convertible auf Aktien 21.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	25.01.2016	25.01.2018	30 179 672		-	100.000	100.000	19.01. 21.04.	0.000 0.000	N
9 % Reverse Convertible auf Tesla Motors Rg	CHF	1'000.00	30.01.2017	30.01.2018	35 272 831	%	72.600	100.000	100.000		0.000	Y
8.35 % Reverse Convertible auf Twitter Rg	CHF	1'000.00	07.02.2017	07.02.2018	30 039 184	%	101.160	100.000	100.000		0.000	Y
4.5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.02.2017	09.02.2018	27 479 987	%	99.950	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	USD	557.50	12.08.2015	12.02.2018	28 154 660	CHF	557.740	97.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Indizes	USD	1'000.00	13.02.2015	13.02.2018	26 670 512	%	59.720	96.340	100.000		0.000	Y
5.28 % Reverse Convertible auf Apple	USD	1'000.00	13.02.2017	13.02.2018	35 272 886	%	99.810	100.000	100.000		0.000	Y
7.32 % Reverse Convertible auf Facebook-A	USD	1'000.00	13.02.2017	13.02.2018	35 272 885	%	99.900	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.02.2015	16.02.2018	26 670 517	%	54.720	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf UBS Group N	CHF	1'000.00	17.08.2016	16.02.2018	32 950 656	%	96.110	100.000	100.000		0.000	Y
9.5 % Reverse Convertible auf Aktien 13.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	16.02.2017	16.02.2018	27 480 009		-	100.000	100.000	14.03. 13.04. 12.05. 14.06. 13.07. 14.08. 14.09. 13.10.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	19.02.2015	19.02.2018	26 670 481	%	132.690	100.000	100.000		0.000	Y
5.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.02.2015	19.02.2018	26 670 448	%	101.020	100.000	100.000	19.02.	0.000	N
3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.02.2016	19.02.2018	30 179 753	%	100.810	100.000	100.000	19.02. 19.05. 19.08. 19.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
6.23 % Reverse Convertible auf ARYZTA N	CHF	1'000.00	21.02.2017	21.02.2018	27 480 014	%	100.290	100.000	100.000		0.000	Y
9.25 % Reverse Convertible auf ARYZTA N	CHF	1'000.00	21.02.2017	21.02.2018	27 480 016	%	100.680	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
7.97 % Reverse Convertible auf ARYZTA N	CHF	1'000.00	21.02.2017	21.02.2018	27 480 015	%	100.530	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Indizes 21.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	26.02.2015	26.02.2018	24 204 116		-	100.000	100.000	22.02. 21.08.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.02.2015	26.02.2018	26 670 566	%	57.480	100.000	100.000		0.000	Y
6.72 % Reverse Convertible auf Aktien 25.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	AUD	1'000.00	27.02.2015	27.02.2018	26 670 529		-	100.000	100.000	25.01. 23.02. 24.03. 25.04. 24.05. 23.06. 24.07. 24.08. 24.09. 25.10.	1.427 1.469 1.475 1.416 1.332 1.387 1.467 1.442 1.456 1.490	N
5.3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	05.03.2015	05.03.2018	26 670 535	%	101.260	100.000	100.000	05.03.	0.000	N
Underlying Tracker auf Indizes	CHF	1'000.00	06.03.2015	06.03.2018	26 670 579	%	120.150	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	06.03.2015	06.03.2018	26 670 580	%	123.040	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf SPDR S&P OilGs ExPr	EUR	1'000.00	09.03.2015	09.03.2018	24 204 167	%	98.620	99.580	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.03.2015	09.03.2018	26 670 667	%	65.520	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes	EUR	1'000.00	09.03.2015	09.03.2018	24 204 168	%	101.800	99.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	10.03.2015	12.03.2018	26 670 679	%	73.220	96.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf ESTX50 EUR P	CHF	1'000.00	12.03.2015	12.03.2018	26 670 623	%	119.210	100.000	100.000		0.000	Y
5.3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.03.2017	13.03.2018	27 480 038	%	104.770	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 14.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.43%	GBP	1'000.00	16.09.2015	16.03.2018	28 154 848		-	97.230	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.03.2015	19.03.2018	24 204 212	%	102.430	100.000	100.000	19.03.	0.000	N
11 % Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	19.12.2016	19.03.2018	34 474 531	%	57.280	100.000	100.000	14.03. 14.06. 14.09. 14.12.	2.922 2.802 2.804 2.871	N
15.2 % Reverse Convertible auf Aktien 14.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.12.2016	19.03.2018	34 474 523		-	100.000	100.000	14.03. 14.06.	0.000 0.000	N
10.2 % Reverse Convertible auf Aktien 14.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	19.12.2016	19.03.2018	34 474 529		-	100.000	100.000	14.03. 14.06.	0.000 0.000	N
2 3/4 % Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	20.03.2015	20.03.2018	26 670 714	%	85.100	100.000	100.000	20.03.	0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien 19.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	21.09.2016	21.03.2018	33 705 548		-	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate auf Aktien	USD	100.00	29.11.2013	23.03.2018	21 820 568	%	20.560	94.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	23.03.2015	23.03.2018	24 204 228	%	96.130	96.340	100.000		0.000	Y
Capital Protection Certificate auf Aktien	USD	1'000.00	25.03.2014	26.03.2018	23 403 348	%	107.240	90.360	95.000		0.000	Y
2 3/4 % Reverse Convertible auf Aktien 23.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	26.03.2015	26.03.2018	26 670 688		-	100.000	100.000	23.03.	0.000	N
3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.03.2015	27.03.2018	26 670 624	%	100.160	100.000	100.000	27.03.	0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	27.03.2015	27.03.2018	26 670 734	%	89.020	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Aktien 22.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	28.09.2015	28.03.2018	28 154 858		-	100.000	100.000	23.03. 22.06. 22.09. 22.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
7.2 % Reverse Convertible auf Aktien 23.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	10'000.00	29.03.2016	29.03.2018	30 179 881		-	100.000	100.000	23.03.	0.000	N
4.32 % Reverse Convertible auf ESTX50 EUR P 28.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.03.2015	30.03.2018	24 204 259		-	100.000	100.000	28.03. 28.06.	0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible auf Aktien 29.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	05.10.2015	05.04.2018	28 154 882		-	100.000	100.000	30.03. 29.06.	0.000 0.000	N
5.4 % Reverse Convertible auf Indizes 30.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	05.10.2015	05.04.2018	28 154 883		-	100.000	100.000	30.03.	0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien 3.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.466%	USD	1'000.00	06.04.2015	06.04.2018	23 403 380		-	96.660	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4.4 % Reverse Convertible auf Indizes	EUR	1'000.00	09.04.2015	09.04.2018	27 480 209		-	100.000	100.000	06.01. 06.04. 06.07.	0.34844 0.34776 0.35693	N
6.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
4.8 % Reverse Convertible auf Indizes	USD	1'000.00	09.04.2015	09.04.2018	27 480 210		-	100.000	100.000	06.01. 06.04. 06.07.	2.914 2.886 2.768	N
6.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.04.2015	09.04.2018	27 480 212		-	100.000	100.000	06.01. 06.04. 06.07. 06.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
6.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
3.6 % Reverse Convertible Called for red.on 06.07.17 at 100%	CHF	1'000.00	09.04.2015	09.04.2018	27 480 208		-	100.000	100.000	06.01. 06.04. 06.07.	0.000 0.000 0.000	N
6.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
1.2 % Structured Note Credit-Linked on Basket of Reference Entities	EUR	1'000.00	05.03.2015	10.04.2018	26 670 633	%	96.860	100.000	100.000	10.04.	12.821	N
Express-Zert. auf Rohstoffe	USD	1'000.00	30.04.2013	13.04.2018	18 426 101	%	94.790	95.710	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	16.10.2015	16.04.2018	27 479 627	%	105.800	99.780	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	18.04.2016	18.04.2018	31 727 365		-	100.000	100.000	12.01. 13.04.	0.000 0.000	N
13.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
9.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.10.2016	19.04.2018	27 479 916		-	100.000	100.000	19.01. 21.04.	0.000 0.000	N
21.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.04.2017	20.04.2018	35 273 083	%	116.960	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	20.04.2017	20.04.2018	35 273 084	%	118.200	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	USD	1'000.00	24.04.2015	24.04.2018	27 480 261	%	160.090	96.890	100.000		0.000	Y
3.38 % Reverse Convertible auf ESTX50 EUR P	CAD	1'000.00	24.04.2015	24.04.2018	27 480 330		-	100.000	100.000	21.04.	4.138	N
21.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
12.3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.04.2017	24.04.2018	27 480 065	%	98.040	100.000	100.000	22.05. 22.06. 20.07. 22.08. 21.09. 20.10. 22.11. 21.12.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Zurich Insur Grp N	CHF	1'000.00	27.04.2016	27.04.2018	31 727 451	%	98.230	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Novartis N	CHF	1'000.00	27.04.2016	27.04.2018	31 727 452	%	95.630	100.000	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	30.10.2015	30.04.2018	28 154 994		-	100.000	100.000	26.01. 27.04.	0.000 0.000	N
27.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
6.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.10.2015	30.04.2018	28 154 993		-	100.000	100.000	26.01. 27.04. 27.07. 26.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
26.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
3.1 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.04.2015	07.05.2018	27 480 145	%	99.970	100.000	100.000	07.05.	0.000	N
3.1 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	07.05.2015	07.05.2018	27 480 255	%	102.320	100.000	100.000	07.05.	1.417	N
3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.05.2015	07.05.2018	27 480 254	%	102.150	100.000	100.000	07.05.	0.000	N
Capital Protection-Cert. on Equities	CHF	1'000.00	07.05.2013	08.05.2018	21 057 753	%	99.330	98.170	100.000		0.000	Y
4.2 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	08.05.2015	08.05.2018	27 480 313		-	100.000	100.000	27.01. 27.04.	0.000 0.000	N
27.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
5 % Reverse Convertible auf Indizes	EUR	1'000.00	08.05.2015	08.05.2018	27 480 314		-	100.000	100.000	27.01. 27.04.	0.26713 0.27021	N
27.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
0.95 % Reverse Convertible auf Basket	CHF	1'000.00	15.05.2015	15.05.2018	28 154 215	%	101.410	100.000	100.000	15.05.	0.000	N
5.4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.05.2015	15.05.2018	27 480 384		-	100.000	100.000	13.02. 11.05.	0.000 0.000	N
11.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung												

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.05.2015	22.05.2018	28 154 191	%	100.350	100.000	100.000	20.02. 18.05. 18.08. 20.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
6 % Reverse Convertible auf Aktien 18.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	22.05.2015	22.05.2018	28 154 192		-	100.000	100.000	20.02. 18.05.	0.45237 0.46267	N
6 % Reverse Convertible auf Aktien 20.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	22.05.2015	22.05.2018	28 154 193		-	100.000	100.000	21.02. 18.05. 18.08. 20.11.	3.079 2.984 2.933 3.022	N
Reverse Convertible auf JC Penney Rg	CHF	1'000.00	22.05.2017	22.05.2018	35 552 925	%	79.600	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.11.2014	24.05.2018	23 403 478	%	27.550	99.790	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	28.11.2014	28.05.2018	25 824 466	%	131.200	99.790	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf STXE6O&G EUR P	EUR	1'000.00	28.05.2015	28.05.2018	27 480 419	%	100.690	99.490	100.000		0.000	Y
7.2 % Reverse Convertible auf Aktien 25.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	29.05.2015	29.05.2018	28 154 226		-	100.000	100.000	27.02. 25.05.	2.891 2.795	N
Underlying Tracker auf Gold 1 Uz	USD	1'000.00	29.05.2015	29.05.2018	24 204 419	%	108.490	96.570	100.000		0.000	Y
5.6 % Reverse Convertible auf Aktien 25.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	29.05.2015	29.05.2018	28 154 224		-	100.000	100.000	27.02. 26.05. 25.08.	0.000 0.000 0.000	N
6.6 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	29.05.2015	29.05.2018	28 154 225	%	89.780	100.000	100.000	27.02. 25.05. 25.08. 27.11.	0.48024 0.49056 0.51201 0.52609	N
6.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.05.2015	29.05.2018	28 154 223	%	99.820	100.000	100.000	27.02. 26.05. 25.08. 27.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
7.2 % Reverse Convertible auf Aktien 27.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung 27.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.11.2015	30.05.2018	30 179 456		-	100.000	100.000	27.02. 26.05. 25.08. 27.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Protection Participation auf Aktien	AUD	1'000.00	04.06.2015	04.06.2018	27 480 405	%	102.000	93.520	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	NOK	1'000.00	04.06.2015	04.06.2018	27 480 404	%	100.390	94.390	98.500		0.000	Y
Structured Note auf Crude Oil-Future	USD	1'000.00	04.06.2015	04.06.2018	28 154 245	%	96.560	91.660	95.000		0.000	Y
8.9 % Reverse Convertible auf Aktien 2.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.06.2017	06.06.2018	27 480 082		-	100.000	100.000	03.07. 03.08. 31.08. 03.10. 02.11.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf SMI	CHF	1'000.00	11.06.2015	11.06.2018	28 154 254	%	100.970	100.000	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible auf Indizes 9.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	12.06.2015	12.06.2018	28 154 292		-	100.000	100.000	09.03. 09.06.	0.45621 0.46116	N
3.4 % Reverse Convertible auf Indizes 9.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	12.06.2015	12.06.2018	28 154 291		-	100.000	100.000	09.03. 09.06.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	12.06.2015	12.06.2018	28 154 285	%	83.170	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Aktien 8.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung 8.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	12.06.2015	12.06.2018	28 154 290		-	100.000	100.000	09.03. 09.06. 08.09. 08.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.06.2016	13.06.2018	27 479 822	%	169.290	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.06.2016	13.06.2018	27 479 823	%	168.880	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf SMI	CHF	1'000.00	16.06.2015	15.06.2018	28 154 359	%	103.020	100.000	100.000		0.000	Y
6.6 % Reverse Convertible auf Aktien 13.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	15.06.2016	15.06.2018	31 727 641		-	100.000	100.000	13.03. 13.06.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf The Swatch Grp	CHF	1'000.00	15.06.2016	15.06.2018	31 727 684	%	134.350	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate auf Aktien	USD	1'000.00	28.06.2013	18.06.2018	20 988 741	%	101.590	93.870	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
6 % Reverse Convertible auf Aktien 15.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.06.2015	19.06.2018	28 154 356		-	100.000	100.000	16.03. 15.06. 15.09. 15.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	19.06.2015	19.06.2018	28 154 350	%	95.480	100.000	100.000		0.000	Y
8.4 % Reverse Convertible auf Aktien 15.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	20.06.2016	20.06.2018	31 727 671		-	100.000	100.000	16.03. 15.06.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf UBS Group N	CHF	1'000.00	27.06.2016	27.06.2018	31 727 741	%	71.230	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Aktien 21.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung 21.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	28.12.2015	28.06.2018	30 179 474		-	100.000	100.000	23.03. 22.06. 21.09. 21.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Indizes	USD	1'000.00	29.06.2015	29.06.2018	26 670 844	%	100.620	96.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 27.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	29.12.2016	29.06.2018	27 479 963		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 29.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.224%	USD	1'000.00	24.06.2015	02.07.2018	26 670 809		-	96.110	100.000		0.000	Y
8.6 % Reverse Convertible auf Aktien 29.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	05.07.2016	05.07.2018	31 727 751		-	100.000	100.000	30.03. 29.06.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	06.07.2016	06.07.2018	31 727 748	%	180.270	100.000	100.000		0.000	Y
3.36 % Reverse Convertible auf Aktien 5.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	09.07.2015	09.07.2018	28 154 473		-	100.000	100.000	06.01. 06.04. 06.07. 05.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien 6.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.561%	GBP	1'000.00	11.01.2017	11.07.2018	27 479 966		-	99.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-11.07.18 auf Aktien 10.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.571%	GBP	1'000.00	12.01.2017	12.07.2018	34 474 644		-	99.240	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate auf Aktien	CHF	1'000.00	17.07.2013	17.07.2018	21 387 535	%	19.790	96.620	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	18.10.2016	18.07.2018	33 705 619	%	152.150	100.000	100.000		0.000	Y
3 % Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	23.07.2015	23.07.2018	28 154 496	%	108.160	100.000	100.000	23.07.	0.000	N
Reverse Convertible auf Bombard -B- SubVtg 19.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.935%	EUR	1'000.00	23.07.2015	23.07.2018	28 154 553		-	99.370	100.000		0.000	Y
6.2 % Reverse Convertible auf Aktien 20.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	24.07.2015	24.07.2018	28 154 518		-	100.000	100.000	20.01. 21.04. 20.07.	0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	24.07.2015	24.07.2018	28 154 514	%	89.780	100.000	100.000		0.000	Y
5.2 % Reverse Convertible auf Aktien 20.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	10'000.00	24.07.2015	24.07.2018	28 154 519		-	100.000	100.000	20.01. 21.04. 20.07.	0.000 0.000 0.000	N
6.4 % Reverse Convertible auf Aktien 20.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	24.07.2015	24.07.2018	28 154 520		-	100.000	100.000	20.01. 21.04. 20.07. 20.10.	0.56358 0.56041 0.58107 0.6086	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	24.01.2017	24.07.2018	30 039 183	%	125.680	100.000	100.000		0.000	Y
14 % Reverse Convertible auf Aktien 25.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	27.01.2017	27.07.2018	35 272 803		-	100.000	100.000	25.04. 25.07.	3.277 3.131	N
Underlying Tracker auf S&P 500	USD	1'000.00	30.01.2015	30.07.2018	24 204 015	%	135.910	96.140	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	30.01.2015	30.07.2018	24 204 016	%	107.200	96.140	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	30.01.2015	30.07.2018	26 670 397	%	108.030	96.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 28.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.036%	USD	1'000.00	23.07.2015	30.07.2018	27 479 484		-	96.350	100.000	26.01.	0.000	Y
4 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	30.07.2015	30.07.2018	28 154 455	%	99.990	100.000	100.000	30.07.	0.000	N

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
6 % Reverse Convertible auf Indizes 27.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	31.07.2015	31.07.2018	28 154 559		-	100.000	100.000	27.01. 27.04. 27.07. 27.10.	0.50756 0.5134 0.53373 0.54983	N
6 % Reverse Convertible auf Aktien 27.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	02.08.2016	02.08.2018	32 950 526		-	100.000	100.000	26.01. 27.04. 27.07.	0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf SMI	USD	1'000.00	05.08.2015	06.08.2018	28 154 633	CHF	967.080	96.370	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Indizes	USD	1'000.00	07.08.2015	07.08.2018	28 154 609	%	100.480	100.000	100.000	02.02. 03.05. 03.08. 02.11.	3.165 3.171 3.098 3.192	N
5.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.08.2015	07.08.2018	28 154 606	%	98.410	100.000	100.000	02.02. 04.05. 04.08. 02.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
3.8 % Reverse Convertible auf Indizes 2.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.08.2015	07.08.2018	28 154 607		-	100.000	100.000	02.02. 04.05. 04.08. 02.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Protection Participation auf ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	07.08.2015	07.08.2018	28 154 655	%	91.900	92.000	92.500		0.000	Y
4.25 % Reverse Convertible an USD 10Y Swap	USD	1'000.00	08.08.2016	08.08.2018	32 950 552	%	100.710	100.000	100.000	08.08.	41.487	N
Reverse Convertible auf K+S N	EUR	1'000.00	13.08.2015	13.08.2018	28 154 661	%	66.410	99.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.08.2015	13.08.2018	27 479 544	%	68.840	100.000	100.000		0.000	Y
4.4 % Reverse Convertible auf Indizes 10.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	14.08.2015	14.08.2018	28 154 639		-	100.000	100.000	10.02. 11.05. 10.08. 10.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	17.08.2016	17.08.2018	32 950 574	%	118.400	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Tesla Rg 15.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	17.02.2017	17.08.2018	35 272 891		-	100.000	100.000		0.000	Y
3.5 % Reverse Convertible auf Aktien 17.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	20.08.2015	20.08.2018	28 154 637		-	100.000	100.000	16.02. 17.08.	0.000 0.000	N
5.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.08.2015	21.08.2018	28 154 677	%	97.800	100.000	100.000	17.02. 18.05. 17.08. 17.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible auf Aktien 26.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	27.08.2015	27.08.2018	28 154 668		-	100.000	100.000	23.02. 26.05.	0.000 0.000	N
4.28 % Reverse Convertible auf Indizes 23.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	27.08.2015	27.08.2018	27 479 572		-	100.000	100.000	24.02. 26.05. 24.08. 23.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	30.08.2016	30.08.2018	32 950 639	%	125.850	100.000	100.000		0.000	Y
5.4 % Reverse Convertible auf Indizes 30.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	03.03.2015	03.09.2018	26 670 571		-	100.000	100.000	02.03. 02.06. 31.08. 30.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	03.09.2015	03.09.2018	28 154 712	%	136.250	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Aktien 1.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	04.09.2015	04.09.2018	28 154 748		-	100.000	100.000	03.03. 01.06. 31.08. 01.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf UBS Group N	CHF	1'000.00	05.09.2016	05.09.2018	33 705 471	%	91.860	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Clariant N	CHF	1'000.00	05.09.2016	05.09.2018	33 705 472	%	99.460	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Novartis N	CHF	1'000.00	05.09.2016	05.09.2018	33 705 470	%	84.790	100.000	100.000		0.000	Y
9 % Reverse Convertible auf Aktien 1.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.03.2016	07.09.2018	30 179 821		-	100.000	100.000	02.03. 01.06.	0.000 0.000	N

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4.32 % Reverse Convertible auf Indizes 5.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	10.03.2015	10.09.2018	23 403 143		-	100.000	100.000	03.03. 05.06.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	10.09.2015	10.09.2018	28 154 746	%	115.200	100.000	100.000		0.000	Y
4.8 % Reverse Convertible auf Indizes 9.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.09.2015	11.09.2018	28 154 784		-	100.000	100.000	09.03. 09.06.	0.000 0.000	N
3.6 % Reverse Convertible auf Indizes 11.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	13.03.2015	13.09.2018	26 670 647		-	100.000	100.000	09.03. 09.06. 11.09.	0.000 0.000 0.000	N
4.4 % Reverse Convertible auf Indizes 9.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	13.03.2015	13.09.2018	26 670 648		-	100.000	100.000	09.03. 09.06.	0.45621 0.46116	N
3.88 % Reverse Convertible auf Indizes 9.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	13.03.2015	13.09.2018	24 204 196		-	100.000	100.000	09.03. 09.06.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	17.09.2015	17.09.2018	28 154 807	%	140.340	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	17.06.2016	17.09.2018	31 727 639	%	116.860	100.000	100.000		0.000	Y
6.2 % Reverse Convertible auf Indizes 15.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.09.2015	18.09.2018	28 154 816		-	100.000	100.000	16.03. 15.06.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	19.09.2016	19.09.2018	33 705 483	%	139.210	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	20.03.2015	20.09.2018	24 204 224	%	116.650	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	24.09.2015	24.09.2018	28 154 849	%	101.790	100.000	100.000		0.000	Y
6.2 % Reverse Convertible auf Aktien 21.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	24.09.2015	24.09.2018	28 154 834		-	100.000	100.000	22.03. 22.06. 21.09. 21.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Worst of Express Certificate auf Fonds	GBP	1'000.00	02.10.2013	26.09.2018	21 820 592	%	100.760	90.690	100.000		0.000	Y
4.16 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.09.2014	26.09.2018	24 204 567	%	78.530	100.000	100.000	29.03. 23.06. 29.09. 29.12.	0.300 0.300 0.300 0.300	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	27.09.2016	27.09.2018	33 705 536	%	174.690	100.000	100.000		0.000	Y
6.6 % Reverse Convertible auf Aktien 21.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.09.2016	27.09.2018	33 705 524		-	100.000	100.000	22.03. 22.06. 21.09.	0.000 0.000 0.000	N
10 % Reverse Convertible auf Aktien 23.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	01.04.2016	01.10.2018	30 179 879		-	100.000	100.000	23.03.	0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	03.10.2014	03.10.2018	24 204 583	%	126.760	99.480	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible auf Aktien 29.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	03.10.2016	03.10.2018	33 705 572		-	100.000	100.000	30.03. 29.06. 29.09.	0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	09.10.2015	09.10.2018	28 154 907	%	120.840	100.000	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible auf Aktien 5.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	11.10.2016	11.10.2018	33 705 583		-	100.000	100.000	06.01. 06.04. 07.07. 05.10.	2.584 2.560 2.459 2.493	N
8.2 % Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	17.10.2016	17.10.2018	33 705 608	%	89.680	100.000	100.000	12.01. 13.04. 13.07. 13.10.	2.444 2.436 2.346 2.363	N
Underlying Tracker auf Aktien	USD	1'000.00	17.10.2016	17.10.2018	33 705 598	%	145.630	97.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	18.10.2016	18.10.2018	33 705 621	%	133.290	100.000	100.000		0.000	Y
Capital Protection-Zert. on Basket	CHF	1'000.00	23.10.2013	23.10.2018	21 820 611	%	113.160	96.430	100.000		0.000	Y
Capital Protection-Zert. auf Basket	EUR	1'000.00	23.10.2013	23.10.2018	21 820 610	%	118.230	93.700	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Aktien 19.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung 19.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	23.10.2015	23.10.2018	28 154 969		-	100.000	100.000	19.01. 21.04. 20.07. 19.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4.6 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	23.10.2015	23.10.2018	28 154 970		-	100.000	100.000	20.01.	0.000	N
										21.04.	0.000	
										20.07.	0.000	
20.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
5 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	24.04.2015	24.10.2018	27 480 275		-	100.000	100.000	20.01.	0.000	N
										21.04.	0.000	
										20.07.	0.000	
										20.10.	0.000	
20.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
10.2 % Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	24.10.2016	24.10.2018	33 705 628		-	100.000	100.000	20.01.	2.689	N
										20.04.	2.661	
										20.07.	2.544	
										19.10.	2.606	
19.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.10.2016	24.10.2018	33 705 625		-	100.000	100.000	19.01.	0.000	N
										21.04.	0.000	
										20.07.	0.000	
										19.10.	0.000	
19.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Reverse Convertible auf UBS Group N	CHF	1'000.00	26.04.2016	26.10.2018	31 727 442	%	33.800	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	EUR	100.00	29.04.2015	29.10.2018	26 668 541	CHF	58.170	99.650	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	29.10.2015	29.10.2018	28 154 985	%	86.270	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	USD	1'000.00	31.10.2016	31.10.2018	33 705 643	%	190.340	97.970	100.000		0.000	Y
6.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.11.2015	02.11.2018	28 155 011		-	100.000	100.000	31.01.	0.000	N
										02.05.	0.000	
										31.07.	0.000	
										31.10.	0.000	
31.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	06.11.2015	06.11.2018	28 155 045	%	117.730	100.000	100.000		0.000	Y
6.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.11.2015	06.11.2018	28 155 052		-	100.000	100.000	02.02.	0.000	N
										04.05.	0.000	
										03.08.	0.000	
										02.11.	0.000	
2.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
4.6 % Reverse Convertible auf Indizes	EUR	1'000.00	06.11.2015	06.11.2018	28 155 032		-	100.000	100.000	02.02.	0.13363	N
										04.05.	0.13556	
										03.08.	0.14377	
3.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	10'000.00	06.05.2016	06.11.2018	31 727 424	%	101.330	100.000	100.000	26.01.	0.000	N
										27.04.	0.000	
										27.07.	0.000	
										26.10.	0.000	
Underlying Tracker auf STXE6 EUR P	EUR	1'000.00	07.05.2015	07.11.2018	24 204 373	%	92.670	99.550	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	07.11.2016	07.11.2018	33 705 686		-	100.000	100.000	02.02.	0.000	N
										04.05.	0.000	
										03.08.	0.000	
										02.11.	0.000	
2.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
2.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	09.11.2016	09.11.2018	33 705 703	%	153.710	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	EUR	100.00	12.11.2014	12.11.2018	25 824 404	CHF	64.180	98.460	100.000		0.000	Y
5.6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	10'000.00	12.11.2015	12.11.2018	28 155 048	%	99.930	100.000	100.000	09.02.	0.000	N
										10.05.	0.000	
										10.08.	0.000	
										09.11.	0.000	
Underlying Tracker auf Nokia	EUR	1'000.00	12.11.2015	12.11.2018	27 479 686	%	53.740	99.880	100.000		0.000	Y
5.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.11.2016	16.11.2018	33 705 732	%	102.620	100.000	100.000	16.11.	0.000	N
3.2 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	16.11.2016	16.11.2018	33 705 734		-	100.000	100.000	14.02.	0.000	N
										12.05.	0.000	
										14.08.	0.000	
										14.11.	0.000	
14.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Underlying Tracker auf SMI	USD	1'000.00	17.11.2014	19.11.2018	25 824 445	%	102.620	94.320	100.000		0.000	Y
5.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.11.2015	20.11.2018	30 179 418		-	100.000	100.000	16.02.	0.000	N
										18.05.	0.000	
18.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.11.2014	21.11.2018	25 824 446		-	100.000	100.000	16.02.	0.225	N
										17.05.	0.225	
17.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung												

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker auf Tesla Rg	CHF	1'000.00	23.05.2017	23.11.2018	35 552 902	%	107.220	100.000	100.000		0.000	Y
4.2 % Reverse Convertible auf Indizes 24.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	27.11.2015	27.11.2018	30 179 438		-	100.000	100.000	24.02. 25.05.	0.000 0.000	N
4.2 % Reverse Convertible auf Indizes 23.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.11.2015	30.11.2018	30 179 453		-	100.000	100.000	24.02. 26.05. 24.08. 23.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
4.12 % Reverse Convertible auf Indizes 30.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	03.12.2015	03.12.2018	27 479 716		-	100.000	100.000	02.03. 31.05. 31.08. 30.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	04.12.2015	04.12.2018	30 179 475	%	116.550	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Aktien 1.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	05.12.2014	05.12.2018	26 105 187		-	100.000	100.000	01.12.	4.000	N
5 % Reverse Convertible auf Indizes 9.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	11.12.2015	11.12.2018	30 179 517		-	100.000	100.000	09.03. 09.06.	0.000 0.000	N
4 % Reverse Convertible auf Aktien 8.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung 8.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	12.12.2014	12.12.2018	26 105 219		-	100.000	100.000	08.12.	0.900	N
Protection Participation auf USD/CHF	CHF	1'000.00	12.12.2016	12.12.2018	34 474 452	%	95.470	95.000	95.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	14.12.2016	14.12.2018	34 474 502	%	151.140	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Indizes 14.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	17.12.2014	17.12.2018	26 105 215		-	100.000	100.000	14.12.	0.79777	N
5.9 % Reverse Convertible auf Aktien 14.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung 14.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	17.12.2014	17.12.2018	23 403 100		-	100.000	100.000	14.12.	0.79777	N
5.4 % Reverse Convertible auf Aktien 15.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.12.2014	19.12.2018	26 105 284		-	100.000	100.000	15.12.	1.000	N
5.6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.12.2015	21.12.2018	30 179 568	%	99.210	100.000	100.000	17.03. 19.06. 19.09. 19.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	24.06.2015	24.12.2018	28 154 355	%	119.090	100.000	100.000		0.000	Y
5.8 % Reverse Convertible auf Aktien 22.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	28.12.2015	28.12.2018	30 179 577		-	100.000	100.000	23.03. 22.06.	0.000 0.000	N
Capital Protection-Zert. auf Basket mit Referenzanleihe	USD	1'000.00	09.10.2013	03.01.2019	22 293 428	%	102.870	86.190	100.000		0.000	Y
2.85 % Credit Linked mit Kreditrisiko auf Generali	EUR	1'000.00	18.12.2013	03.01.2019	22 551 183	%	99.120	100.000	100.000	03.01.	30.366	N
Reverse Convertible auf Aktien 28.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	03.07.2017	03.01.2019	27 480 094		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	10'000.00	07.07.2016	07.01.2019	31 727 731	%	125.800	100.000	100.000		0.000	Y
Structured Note mit Kreditrisiko auf Commerzbank	EUR	1'000.00	16.12.2014	09.01.2019	26 105 273	%	95.940	100.000	100.000	09.01. 10.04. 10.07. 09.10.	1.239 1.158 1.168 1.220	N
6.2 % Reverse Convertible auf Aktien 13.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung 13.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	15.01.2016	15.01.2019	30 179 625		-	100.000	100.000	12.01. 13.04.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	15.01.2016	15.01.2019	30 179 605	%	119.750	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Aktien 12.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	16.01.2015	16.01.2019	26 105 356		-	100.000	100.000	12.01. 13.04. 13.07. 12.10.	0.025 0.025 0.025 0.025	N
5.4 % Reverse Convertible auf Indizes 13.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	16.01.2015	16.01.2019	26 105 357		-	100.000	100.000	12.01. 13.04.	0.025 0.025	N
5.5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.01.2015	22.01.2019	26 105 377	%	103.750	100.000	100.000	22.01.	0.000	N
5 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.01.2015	22.01.2019	25 609 288	%	104.890	100.000	100.000	19.01.	0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	22.01.2016	22.01.2019	30 179 662	%	131.030	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
6.4 % Reverse Convertible auf Rohstoffe 19.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CAD	1'000.00	22.07.2016	22.01.2019	32 950 446		-	100.000	100.000	19.01. 19.04. 19.07. 19.10.	1.687 1.652 1.685 1.739	N
6 % Reverse Convertible auf Aktien 20.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	23.01.2015	23.01.2019	26 105 405		-	100.000	100.000	19.01. 21.04. 20.07.	0.000 0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible auf Indizes 27.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.01.2015	30.01.2019	26 670 366		-	100.000	100.000	26.01. 27.04.	0.000 0.000	N
7 % Reverse Convertible auf Aktien 27.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.01.2015	30.01.2019	26 670 365		-	100.000	100.000	26.01. 27.04.	0.000 0.000	N
5.8 % Reverse Convertible auf Aktien 27.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.01.2015	30.01.2019	26 670 341		-	100.000	100.000	26.01. 27.04. 27.07.	0.000 0.000 0.000	N
6.2 % Reverse Convertible auf Aktien 3.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.02.2015	06.02.2019	26 670 401		-	100.000	100.000	02.02. 03.05.	0.000 0.000	N
Capital Protection-Cert. 1 auf Basket	EUR	1'000.00	11.02.2014	11.02.2019	22 551 220	%	114.770	95.150	100.000		0.000	Y
Capital Protection-Zert. auf Basket	CHF	1'000.00	11.02.2014	11.02.2019	22 551 218	%	110.590	97.540	100.000		0.000	Y
6.4 % Reverse Convertible auf Aktien 11.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	13.02.2015	13.02.2019	26 670 456		-	100.000	100.000	09.02. 11.05.	0.000 0.000	N
CPC with Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	14.02.2014	14.02.2019	23 403 183	%	108.780	95.540	98.000		0.000	Y
Capital Protection-Zert. on Equities	CHF	100.00	21.02.2014	21.02.2019	23 403 195	CHF	104.600	98.460	101.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 20.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	22.02.2017	22.02.2019	35 272 918		-	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate auf Aktien	CHF	1'000.00	26.02.2014	26.02.2019	23 403 060	%	58.770	97.590	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Basket 8.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.026%	USD	1'000.00	11.03.2015	11.03.2019	24 204 164		-	94.290	100.000		0.000	Y
5.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.03.2015	11.03.2019	26 670 630	%	99.290	100.000	100.000	09.03. 08.06. 07.09. 07.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Capital Protection-Zert. auf Basket	NOK	1'000.00	13.03.2014	13.03.2019	23 403 252	CHF	133.070	92.800	105.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.03.2015	19.03.2019	24 204 216	%	97.710	100.000	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible auf Aktien 16.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	20.03.2015	20.03.2019	26 670 697		-	100.000	100.000	16.03. 16.06.	0.000 0.000	N
(ohne Min.) Reverse Convertible auf CHF 30Y Swap	CHF	1'000.00	27.02.2014	22.03.2019	23 403 239	%	67.060	100.000	100.000	15.03. 15.06. 15.09. 17.12.	2.532 2.539 2.530 2.530	N
Underlying Tracker auf EM	USD	1'000.00	25.03.2016	25.03.2019	30 179 877	%	138.250	96.970	100.000		0.000	Y
Capital-Protection-Zert. auf Aktien-Basket	EUR	1'000.00	27.03.2014	27.03.2019	23 403 293	%	111.720	94.910	100.000		0.000	Y
Capital Protection-Zert. auf Aktien	CHF	1'000.00	27.03.2014	27.03.2019	23 403 294	%	106.480	97.390	100.000		0.000	Y
Kapitalschutz-Zert. auf Aktien 24.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.031%	USD	1'000.00	27.03.2014	27.03.2019	23 403 295		-	91.470	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	08.04.2016	08.04.2019	31 727 341	%	130.660	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.04.2015	09.04.2019	27 480 153	%	100.770	100.000	100.000	30.03. 30.06. 02.10.	0.000 0.000 0.000	N
3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.04.2015	09.04.2019	27 480 173	%	100.010	100.000	100.000	09.04.	0.000	N
5 % Reverse Convertible auf Aktien 5.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	09.04.2015	09.04.2019	27 480 211		-	100.000	100.000	06.01. 06.04. 06.07. 05.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Referenzschuldner-Zert. auf Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	12.02.2014	10.04.2019	23 403 210	%	104.470	92.040	100.000		0.000	Y
7.8 % Reverse Convertible auf Aktien 6.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.04.2016	11.04.2019	31 727 346		-	100.000	100.000	06.01. 06.04.	0.000 0.000	N

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4.2 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	17.04.2015	17.04.2019	27 480 238	%	100.370	100.000	100.000	13.01.	0.000	N
										13.04.	0.000	
										13.07.	0.000	
										13.10.	0.000	
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.04.2015	17.04.2019	27 480 237	%	98.850	100.000	100.000	13.01.	0.000	N
										13.04.	0.000	
										13.07.	0.000	
										13.10.	0.000	
8 % Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	18.04.2017	18.04.2019	35 273 064	%	99.370	100.000	100.000	13.07.	3.919	N
										13.10.	3.946	
Underlying Tracker auf Indizes	CHF	1'000.00	25.04.2016	25.04.2019	31 727 362	%	137.140	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	02.05.2016	02.05.2019	31 727 418	%	115.910	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.05.2015	07.05.2019	27 480 312	%	75.130	100.000	100.000	27.01.	0.000	N
										27.04.	0.000	
										27.07.	0.000	
										27.10.	0.000	
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	13.05.2016	13.05.2019	31 727 469	%	139.960	100.000	100.000		0.000	Y
5.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.05.2015	15.05.2019	27 480 383		-	100.000	100.000	13.02.	0.000	N
										11.05.	0.000	
										11.08.	0.000	
										13.11.	0.000	
13.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.05.2015	22.05.2019	28 154 190	%	100.060	100.000	100.000	20.02.	0.000	N
										18.05.	0.000	
										18.08.	0.000	
										20.11.	0.000	
5.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.05.2015	29.05.2019	28 154 222	%	99.680	100.000	100.000	27.02.	0.000	N
										26.05.	0.000	
										25.08.	0.000	
										27.11.	0.000	
Protection Participation auf Aktien	GBP	1'000.00	04.06.2015	04.06.2019	27 480 406	%	97.190	92.590	98.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf SMI	CHF	1'000.00	05.12.2016	05.06.2019	34 474 423	%	137.990	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	05.12.2016	05.06.2019	34 474 432	%	155.760	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.06.2015	11.06.2019	28 154 265	%	99.840	100.000	100.000	03.03.	0.000	N
										01.06.	0.000	
										31.08.	0.000	
										01.12.	0.000	
3.36 % Reverse Convertible auf Fonds	CHF	1'000.00	12.06.2015	12.06.2019	28 154 239		-	100.000	100.000	09.06.	0.000	N
										07.12.	0.000	
7.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	13.06.2016	13.06.2019	31 727 619	%	124.900	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf The Swatch Grp	CHF	1'000.00	13.12.2016	13.06.2019	27 479 950	%	121.010	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Indices	CHF	1'000.00	19.06.2015	19.06.2019	28 154 390	%	97.610	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Tesla Rg	CHF	1'000.00	19.06.2017	19.06.2019	27 480 084	%	90.910	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	27.12.2016	27.06.2019	34 474 534	%	124.270	100.000	100.000		0.000	Y
8.4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.12.2016	27.06.2019	34 474 538		-	100.000	100.000	23.03.	0.000	N
										23.06.	0.000	
										25.09.	0.000	
										27.12.	0.000	
27.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Underlying Tracker auf Indizes	CHF	1'000.00	01.07.2016	01.07.2019	31 727 732	%	126.650	100.000	100.000		0.000	Y
5.6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.07.2015	03.07.2019	28 154 401	%	98.160	100.000	100.000	30.03.	0.000	N
										29.06.	0.000	
										29.09.	0.000	
7 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.07.2016	05.07.2019	31 727 749		-	100.000	100.000	29.03.	0.000	N
										29.06.	0.000	
29.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.07.2015	08.07.2019	28 154 363	%	92.570	100.000	100.000	08.07.	0.000	N
3 % Reverse Convertible auf Indizes	USD	1'000.00	10.07.2015	10.07.2019	28 154 439	%	99.420	100.000	100.000	08.01.	1.901	N
										06.04.	1.877	
										07.07.	1.803	
										08.10.	1.831	
3.16 % Reverse Convertible auf Fonds	CHF	1'000.00	10.07.2015	10.07.2019	28 154 432		-	100.000	100.000	06.01.	0.000	N
										06.04.	0.000	
										06.07.	0.000	
6.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung												

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.07.2015	22.07.2019	28 154 474	%	95.760	100.000	100.000	19.01. 21.04. 20.07. 19.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.07.2015	24.07.2019	28 154 517	%	95.490	100.000	100.000	20.01. 21.04. 20.07. 20.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
6.4 % Reverse Convertible auf Aktien 20.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	25.07.2016	25.07.2019	32 950 485		-	100.000	100.000	19.01. 21.04. 20.07.	0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	26.07.2016	26.07.2019	32 950 480	%	118.230	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.07.2015	29.07.2019	28 154 505	%	99.290	100.000	100.000	26.01. 27.04. 27.07. 26.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.07.2015	31.07.2019	28 154 557	%	98.540	100.000	100.000	27.01. 27.04. 27.07. 27.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.08.2015	07.08.2019	28 154 605	%	99.790	100.000	100.000	02.02. 04.05. 04.08. 02.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	07.02.2017	07.08.2019	35 272 807	%	122.160	100.000	100.000		0.000	Y
6.2 % Reverse Convertible auf Rohstoffe	USD	1'000.00	08.08.2016	08.08.2019	32 950 519	%	100.380	100.000	100.000	02.02. 03.05. 03.08. 03.11.	2.448 2.453 2.396 2.475	N
5 % Reverse Convertible auf Indizes 4.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.08.2016	08.08.2019	32 950 557		-	100.000	100.000	02.02. 04.05. 04.08.	0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	09.08.2016	09.08.2019	32 950 549	%	120.460	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Seadrill Rg	CHF	1'000.00	11.05.2017	13.08.2019	35 552 848	%	14.590	100.000	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible auf Aktien 17.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	22.08.2016	22.08.2019	32 950 624		-	100.000	100.000	16.02. 17.05. 17.08.	0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	22.08.2016	22.08.2019	32 950 618	%	126.560	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	23.02.2017	23.08.2019	27 480 019	%	117.410	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	26.08.2016	26.08.2019	32 950 647	%	110.120	100.000	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible auf Aktien 31.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.09.2016	06.09.2019	32 950 699		-	100.000	100.000	02.03. 31.05. 31.08.	0.000 0.000 0.000	N
10 % Reverse Convertible auf Aktien 14.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.09.2016	19.09.2019	33 705 484		-	100.000	100.000	14.03. 14.06. 14.09.	0.000 0.000 0.000	N
CPC with Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	26.09.2014	26.09.2019	24 204 537	%	103.480	95.940	97.000		0.000	Y
(1 % Min.) Structured Note mit Kreditrisiko auf Raiffeisen Bank Int var.	CHF	1'000.00	26.09.2014	04.10.2019	24 204 540	%	99.690	100.000	100.000	04.01. 04.04. 04.07. 04.10.	2.555 2.500 2.527 2.555	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	07.10.2016	07.10.2019	33 705 577	%	117.030	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Obligationen	CHF	1'000.00	07.10.2014	08.10.2019	24 204 569	CHF	1070.000	95.150	101.000		0.000	Y
8.4 % Reverse Convertible auf Aktien 19.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	24.10.2016	24.10.2019	33 705 623		-	100.000	100.000	19.01. 21.04. 19.07. 19.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	28.10.2016	28.10.2019	33 705 642	%	122.130	100.000	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.10.2015	29.10.2019	28 154 934	%	99.300	100.000	100.000	29.10.	0.000	N
Underlying Tracker auf Zurich Insur Grp N	CHF	1'000.00	04.11.2016	04.11.2019	33 705 672	%	117.530	100.000	100.000		0.000	Y
3.25 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.11.2015	05.11.2019	28 154 963	%	101.480	100.000	100.000	02.11.	0.000	N
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	07.11.2014	07.11.2019	24 204 622	%	102.980	92.560	101.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	07.11.2017	07.11.2019	35 552 870	%	85.610	96.510	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible auf Indizes 8.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.406%	USD	1'000.00	12.11.2014	12.11.2019	23 403 440		-	91.650	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	USD	1'000.00	13.11.2014	13.11.2019	25 824 416	%	102.700	91.380	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	14.11.2016	14.11.2019	33 705 696	%	126.560	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	10'000.00	14.11.2016	14.11.2019	33 705 697	%	120.130	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Zurich Insur Grp N	USD	1'000.00	17.11.2014	18.11.2019	25 824 440	%	95.300	91.370	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf SMI	USD	1'000.00	18.11.2014	18.11.2019	23 403 460	%	102.510	91.870	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Zurich Insur Grp N	USD	1'000.00	27.02.2015	18.11.2019	26 670 594	%	101.780	92.560	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	25.11.2016	25.11.2019	34 474 390	%	119.190	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	26.05.2017	26.11.2019	35 552 936	%	98.920	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	27.11.2014	27.11.2019	25 824 425	%	102.080	99.100	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf SMI-Index	CHF	1'000.00	28.11.2014	28.11.2019	24 204 847	%	100.420	98.960	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	02.12.2016	02.12.2019	34 474 421	%	126.800	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf ESTXSD30 EUR P	USD	1'000.00	03.12.2014	03.12.2019	23 403 516	%	97.320	87.280	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	GBP	1'000.00	11.12.2014	11.12.2019	25 824 460	%	95.360	92.420	100.000		0.000	Y
Structured Note	CHF	1'000.00	12.12.2014	12.12.2019	26 105 180	%	100.200	99.100	100.000		0.000	Y
8.8 % Reverse Convertible auf Aktien 7.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	12.12.2016	12.12.2019	34 474 455		-	100.000	100.000	07.03. 08.06. 07.09. 07.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Protection Participation auf SMI	USD	1'000.00	16.12.2014	16.12.2019	24 203 904	%	100.760	91.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.12.2014	23.12.2019	24 203 919	%	102.290	99.400	100.000		0.000	Y
Structured Note	CHF	1'000.00	24.12.2014	24.12.2019	26 105 352	%	100.270	99.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Nikkei 225	USD	1'000.00	26.12.2014	26.12.2019	24 203 922	%	127.610	92.010	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf STXE6O&G EUR P	EUR	1'000.00	30.12.2014	30.12.2019	24 203 931	%	107.280	98.020	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf STXE6O&G EUR P	USD	1'000.00	09.01.2015	30.12.2019	26 105 385	%	102.960	91.370	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	30.06.2017	30.12.2019	27 480 091	%	122.280	100.000	100.000		0.000	Y
(2 % Min.) Structured Note mit Kreditrisiko auf BANCO DO BRASIL var.	CHF	1'000.00	14.11.2014	03.01.2020	24 204 826	%	97.690	100.000	100.000	03.01. 03.04. 03.07. 03.10.	5.111 5.000 5.055 5.111	N
3.5 % (Structured Note) auf Arcelor Mittal	NOK	1'000.00	27.11.2014	03.01.2020	25 824 502	%	101.930	100.000	100.000	03.01.	4.146	N
(2.5 % Max.) Structured Note Credit Linked on ALCOA floating rate	USD	1'000.00	28.11.2014	03.01.2020	25 824 415	%	97.390	100.000	100.000	03.01. 03.04. 03.07.	6.573 6.269 6.086	N
Protection Participation auf Basket	USD	1'000.00	13.11.2014	06.01.2020	24 204 854	%	102.290	83.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	13.07.2016	13.01.2020	31 727 804	%	116.410	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Swiss Re N	USD	1'000.00	15.01.2015	15.01.2020	26 105 376	%	111.260	91.560	100.000		0.000	Y
Structured Note	USD	1'000.00	16.01.2015	16.01.2020	26 105 257	%	101.410	93.059	100.000		0.000	Y
Structured Note	AUD	1'000.00	30.01.2015	30.01.2020	26 105 398	%	102.870	88.130	100.000		0.000	Y
10.2 % Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	30.01.2017	30.01.2020	35 272 792	%	101.930	100.000	100.000	26.04. 26.07. 26.10.	4.078 3.931 4.085	N
Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	04.02.2015	04.02.2020	26 670 431	%	124.580	92.960	100.000		0.000	Y
Structured Note	NOK	1'000.00	16.02.2015	14.02.2020	26 670 438	%	101.120	93.790	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Basket	SEK	1'000.00	24.02.2015	24.02.2020	24 204 100	%	112.870	98.170	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.02.2015	25.02.2020	26 670 525	%	101.400	100.000	100.000	23.02.	0.000	N
CPC with Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	28.02.2014	28.02.2020	23 403 232	%	108.120	95.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	24.02.2015	03.03.2020	26 670 470	%	110.740	93.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	GBP	1'000.00	02.03.2015	06.03.2020	26 670 507	%	98.120	93.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 8.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.579%	EUR	1'000.00	11.03.2015	11.03.2020	24 204 180		-	98.560	100.000		0.000	Y
CPC with Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	12.03.2014	12.03.2020	23 403 277	%	107.750	96.020	100.000		0.000	Y
2.75 % Reverse Convertible auf CHF 10Y Swap	CHF	1'000.00	13.04.2015	20.03.2020	27 480 148	%	94.890	100.000	100.000	15.03. 15.06. 15.09. 15.12.	6.880 7.027 7.027 6.951	N
Capital Protection with Conditional Coupon auf Aktien	CHF	1'000.00	07.04.2014	07.04.2020	23 403 318	%	109.800	97.030	101.000		0.000	Y
Kapitalschutz-Zert. auf Aktien	CHF	1'000.00	14.04.2014	14.04.2020	23 403 340	%	107.110	95.960	100.000		0.000	Y
Capital Protection-Zert. on basket	CHF	1'000.00	22.04.2014	21.04.2020	23 403 388	%	109.680	97.030	101.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	28.04.2017	28.04.2020	35 552 771	%	106.680	100.000	100.000		0.000	Y
4.6 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.05.2020	31 727 423	%	100.850	100.000	100.000	26.01. 27.04. 27.07. 26.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	USD	1'000.00	18.11.2016	18.05.2020	27 479 934	%	111.580	95.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	28.11.2016	28.05.2020	34 474 393	%	120.800	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	EUR	1'000.00	02.06.2015	02.06.2020	27 480 403	%	100.580	93.170	95.000		0.000	Y
Kapitalschutz-Zert. auf Basket	CHF	100.00	11.07.2014	10.07.2020	24 204 495	CHF	103.500	98.020	101.000		0.000	Y
Underlying Tracker 2015-14.07.20 auf Aktien	USD	1'000.00	17.07.2015	17.07.2020	28 154 510	%	106.020	91.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	27.07.2017	27.07.2020	36 663 483	%	100.270	100.000	100.000		0.000	Y
3.36 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	31.07.2015	31.07.2020	28 154 597	%	97.660	100.000	100.000	27.01. 27.04. 27.07. 27.10.	1.121 1.134 1.179 1.215	N
Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	12.08.2015	12.08.2020	27 479 541	%	99.190	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes	EUR	1'000.00	12.08.2015	12.08.2020	27 479 542	%	100.160	97.970	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	USD	5'000.00	08.09.2017	08.09.2020	37 270 325	%	110.030	95.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	21.09.2016	21.09.2020	33 705 546	%	51.650	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 13.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	22.09.2016	22.09.2020	33 705 547		-	95.530	100.000		0.000	Y
Structured Note	CHF	1'000.00	26.09.2014	05.10.2020	24 204 564	%	91.980	100.000	100.000	05.01. 05.04. 05.07. 05.10.	5.111 5.000 5.055 5.111	N
3.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.10.2016	05.10.2020	33 705 544	%	100.890	100.000	100.000	31.03. 03.10.	0.000 0.000	N
Protection Participation on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	16.07.2015	09.10.2020	28 154 472	%	94.750	83.090	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	21.11.2014	23.11.2020	24 204 834	%	100.230	93.360	95.000		0.000	Y
7.60 % Reverse Convertible auf Aktien 23.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	25.11.2016	25.11.2020	34 474 401		-	100.000	100.000	23.02. 23.05. 23.08. 23.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	27.11.2014	27.11.2020	25 824 426	%	103.500	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.12.2014	14.12.2020	26 105 247	%	22.060	99.040	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	14.12.2016	14.12.2020	34 474 453	%	124.470	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	17.12.2014	17.12.2020	26 105 294	%	102.080	89.320	100.000		0.000	Y
Structured Note auf Aktien	EUR	1'000.00	18.12.2014	18.12.2020	26 105 224	%	101.320	95.162	98.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	21.12.2017	21.12.2020	30 039 197	%	98.540	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	GBP	1'000.00	31.12.2014	31.12.2020	26 105 340	%	109.160	90.860	100.000		0.000	Y
Structured Note mit Kreditrisiko auf Barrick Gl	CHF	1'000.00	31.10.2014	04.01.2021	24 204 647	%	103.840	100.000	100.000	29.12.	10.000	N
Protection Participation auf Basket	CHF	1'000.00	28.11.2014	04.01.2021	25 824 450	%	104.310	98.310	100.000		0.000	Y
Structured Note auf 2.75 Staples 18SrN	CHF	1'000.00	12.12.2014	04.01.2021	26 105 220	%	90.220	100.000	100.000	04.01. 04.04. 04.07.	4.088 4.000 4.044	N
Protection Participation auf Basket	CHF	1'000.00	19.12.2014	04.01.2021	26 105 186	%	100.240	100.000	100.000	04.01.	10.000	N
Structured Note auf Basket	CHF	1'000.00	23.12.2014	04.01.2021	25 824 483	%	30.000	92.830	100.000	04.01.	15.458	N
Structured Note auf NEWMONT MINING	CHF	1'000.00	23.12.2014	04.01.2021	25 824 500	%	100.240	100.000	100.000	04.01. 04.04. 04.07.	5.111 5.000 5.055	N
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	02.02.2015	02.02.2021	26 105 345	%	102.490	95.000	95.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	02.02.2015	02.02.2021	26 105 349	%	108.500	95.000	95.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf SMI	USD	1'000.00	09.02.2015	09.02.2021	26 670 384	%	104.020	93.010	102.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	GBP	1'000.00	10.02.2015	10.02.2021	24 204 028	%	111.580	92.430	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf SMI	USD	1'000.00	19.02.2015	19.02.2021	26 670 475	%	104.080	91.590	102.000		0.000	Y
Protection Participation auf SMI	AUD	1'000.00	19.02.2015	19.02.2021	26 670 476	%	106.510	90.220	105.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Basket	GBP	1'000.00	23.02.2015	23.02.2021	26 670 514	%	131.770	91.620	100.000		0.000	Y
Capital Protection-Zert. 2014-1.2.21 mit Kreditrisiko auf Barrick Gold Corp.	CHF	1'000.00	11.02.2014	30.03.2021	22 551 157	%	108.500	76.180	100.000		0.000	Y
Structured Note auf Bank of China -H-	CHF	1'000.00	19.02.2015	06.04.2021	26 670 385	%	99.870	96.780	100.000	28.03.	7.500	N
Underlying Tracker auf GBP/CHF	USD	1'000.00	02.04.2015	06.04.2021	27 480 189	%	114.760	90.470	100.000		0.000	Y
Structured Note auf Obligationen	EUR	1'000.00	29.04.2015	12.04.2021	27 480 129	%	99.890	100.000	100.000	12.01. 12.04. 12.07. 12.10.	5.489 5.336 5.566 5.910	N

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Structured Note auf Obligationen	CHF	1'000.00	29.04.2015	12.04.2021	27 480 128	%	99.180	100.000	100.000	12.01. 12.04. 12.07. 12.10.	3.577 3.500 3.538 3.577	N
Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	07.05.2015	07.05.2021	27 480 379	%	100.220	100.000	100.000	02.02. 30.04. 30.07. 30.10.	0.7216 0.69992 0.75934 0.77379	N
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.05.2015	18.05.2021	27 480 418	%	66.500	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker MSCI WORLD INDEX	USD	1'000.00	29.05.2015	28.05.2021	28 154 244	%	111.300	89.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf CS Group N	CHF	1'000.00	10.06.2016	10.06.2021	31 727 577	%	136.000	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf UBS Group N	CHF	1'000.00	10.06.2016	10.06.2021	31 727 537	%	128.480	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	22.12.2015	22.06.2021	30 179 534	%	100.490	90.000	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf ESTX50 EUR P 13.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.307%	EUR	1'000.00	15.07.2015	15.07.2021	27 479 466		-	96.420	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf SMI	USD	1'000.00	10.08.2015	10.08.2021	28 154 584	%	96.980	91.040	101.500		0.000	Y
Protection Participation auf MSCI WORLD INDEX	USD	1'000.00	27.08.2015	27.08.2021	28 154 673	%	115.940	89.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 31.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.209%	GBP	1'000.00	02.09.2015	02.09.2021	28 154 766		-	90.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Basket	USD	1'000.00	30.09.2015	30.09.2021	24 204 451	%	114.940	90.590	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	EUR	1'000.00	22.10.2014	22.10.2021	24 204 687	%	104.970	95.300	100.000		0.000	Y
Structured Note auf Aktien	CHF	1'000.00	07.11.2014	08.11.2021	24 204 538	%	102.040	96.900	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	10.11.2014	10.11.2021	24 204 694	%	103.170	96.570	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	15.12.2014	15.12.2021	25 824 490	%	101.280	97.380	100.000		0.000	Y
Structured Note auf Aktien	CHF	1'000.00	19.12.2014	17.12.2021	25 824 448	%	100.530	97.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Silber 1 Uz	USD	1'000.00	18.05.2017	18.05.2022	27 480 079	%	101.600	90.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Gold 1 Uz	USD	1'000.00	18.05.2017	18.05.2022	27 480 078	%	100.570	90.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes	USD	1'000.00	31.07.2017	01.09.2022	27 480 100	%	96.470	91.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.09.2017	20.09.2022	37 270 334	%	95.940	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	17.10.2014	17.10.2022	24 204 592	%	105.070	95.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 20.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.10.2016	19.10.2022	27 479 913		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 25.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	13.10.2016	25.10.2022	27 479 917		-	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf SMI	CHF	1'000.00	31.10.2014	31.10.2022	24 204 717	%	107.890	96.430	101.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 31.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.10.2016	31.10.2022	27 479 922		-	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	07.11.2014	07.11.2022	24 204 692	%	101.280	95.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 31.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.12.2016	03.01.2023	27 479 957		-	100.000	100.000		0.000	Y
Structured Note mit Kreditrisiko auf LAFARGEHOLCIM LTD	EUR	1'000.00	05.11.2015	10.01.2023	28 154 965	%	99.030	91.240	100.000	23.12.	11.742	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	23.01.2015	23.01.2023	26 105 260	%	101.150	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	23.01.2015	23.01.2023	26 105 259	%	103.590	99.999	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 29.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	13.02.2017	24.02.2023	27 480 000		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 19.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.03.2017	17.03.2023	27 480 027		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 19.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.03.2017	17.03.2023	27 480 028		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	06.04.2017	06.04.2023	34 474 663	%	105.380	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.04.2017	06.04.2023	34 474 664	%	98.430	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 14.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	03.04.2017	14.04.2023	27 480 052		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 2.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	20.04.2017	03.05.2023	27 480 059		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 2.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	20.04.2017	03.05.2023	27 480 060		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 2.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	20.04.2017	03.05.2023	27 480 061		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 7.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	24.04.2017	05.05.2023	27 480 064		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 31.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	12.05.2017	01.06.2023	27 480 076		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.07.2017	07.07.2023	35 273 074	%	97.600	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	12.07.2017	12.07.2023	36 663 467	%	99.900	97.000	97.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
0.3 % p.a. Protection Participation auf SMI	CHF	1'000.00	21.11.2014	21.11.2024	24 204 852	%	105.890	96.150	100.000	21.11.	3.000	Y
3.9 % Reverse Convertible auf CHF 10Y Swap	CHF	1'000.00	03.12.2014	20.12.2024	25 824 437	%	82.110	100.000	100.000	15.03. 15.06. 16.09. 16.12.	9.750 9.967 9.967 1.921	N
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	06.03.2015	06.03.2025	26 670 419	%	101.440	98.510	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	09.03.2015	07.03.2025	26 105 322	%	99.080	88.400	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien-Basket	CHF	1'000.00	09.03.2015	07.03.2025	26 105 326	%	98.020	100.000	100.000	08.03.	1.800	N
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	09.03.2015	07.03.2025	26 105 323	%	94.810	78.570	100.000		0.000	Y
Structured Note auf Aktien	CHF	1'000.00	09.03.2015	07.03.2025	26 105 327	%	77.640	93.120	95.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	09.03.2015	07.03.2025	26 105 321	%	101.710	98.220	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Basket	CHF	1'000.00	06.03.2015	03.04.2025	26 670 424	%	106.860	98.400	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	08.06.2015	06.06.2025	26 670 713	%	96.670	78.110	80.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	08.06.2015	06.06.2025	26 670 712	%	99.280	87.870	90.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Solactive Cuba-Focused	CHF	93.55	03.07.2015	03.07.2025	28 154 463	CHF	100.700	95.967	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	31.07.2015	30.07.2025	28 154 516	%	87.460	77.790	80.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	28.12.2015	31.12.2025	28 154 675	%	103.720	98.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	26.01.2016	23.01.2026	30 179 440	%	115.560	99.300	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible auf CHF 10Y Swap	CHF	1'000.00	19.12.2014	18.12.2026	25 824 424	%	88.720	100.000	100.000	15.03. 15.06. 16.09. 16.12.	10.000 10.222 10.333 10.111	N
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	09.03.2015	08.03.2027	26 105 324	%	107.960	104.310	108.000		0.000	Y
Protection Participation auf Indizes	CHF	1'000.00	15.12.2017	16.12.2027	37 270 328	%	100.720	85.660	88.000		0.000	Y
Protection Participation auf Indizes	CHF	1'000.00	15.12.2017	16.12.2027	37 270 329	%	101.400	92.470	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	15.12.2017	16.12.2027	37 270 327	%	100.180	97.340	100.000		0.000	Y
3.9 % ReverseConvertible auf CHF 30Y Swap	CHF	1'000.00	12.11.2014	21.09.2029	24 204 563	%	92.170	100.000	100.000	15.03. 15.06. 15.09. 15.12.	9.750 9.966 9.966 9.858	N
Structured Note auf Aktien	CHF	1'000.00	09.03.2015	08.03.2030	26 105 329	%	106.540	86.460	96.000		0.000	Y
Structured Note auf Aktien	CHF	1'000.00	09.03.2015	08.03.2030	26 105 328	%	90.830	85.560	95.000		0.000	Y
Structured Note auf Aktien	CHF	1'000.00	31.08.2015	30.08.2030	28 154 305	%	96.950	87.760	95.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Notenstein La Roche Privatbank AG, St.Gallen, Schweiz												
6 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.07.2015	09.01.2017	24 206 119		-	100.000	100.000	09.01.	0.000	N
6.6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.01.2015	12.01.2017	24 205 898		-	100.000	100.000	12.01.	0.000	N
7 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.01.2016	13.01.2017	24 206 318		-	100.000	100.000	13.01.	0.000	Y
6.45 % Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	13.01.2016	13.01.2017	24 206 320		-	100.000	100.000	13.01.	2.070	N
7.6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.01.2015	16.01.2017	26 280 810		-	100.000	100.000	16.01.	0.000	N
8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.01.2015	16.01.2017	26 280 808		-	100.000	100.000	16.01.	0.000	N
4.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.07.2015	17.01.2017	26 671 487		-	100.000	100.000	17.01.	0.36392	N
3 % Reverse Convertible auf ESTX50 EUR P	CHF	1'000.00	19.01.2016	19.01.2017	30 049 691		-	100.000	100.000	19.01.	0.000	Y
6.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.01.2016	20.01.2017	24 206 327		-	100.000	100.000	20.01.	0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Crude Oil	USD	1'000.00	20.01.2016	20.01.2017	24 206 315		-	100.000	100.000	20.01.	8.340	Y
6 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.01.2015	23.01.2017	26 280 827		-	100.000	100.000	23.01.	0.000	N
8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.01.2015	23.01.2017	26 280 824		-	100.000	100.000	23.01.	0.000	N
6.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.01.2016	25.01.2017	30 463 202		-	100.000	100.000	25.01.	0.000	Y
8.6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.01.2016	26.01.2017	24 206 341		-	100.000	100.000	26.01.	0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	27.10.2015	27.01.2017	26 671 872		-	100.000	100.000		0.000	Y
7.95 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.12.2015	27.01.2017	24 206 293		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	N
Worst of Express Certificate auf Aktien	USD	1'000.00	30.01.2014	30.01.2017	22 829 389		-	97.460	100.000		0.000	Y
6.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.01.2015	30.01.2017	26 670 949		-	100.000	100.000	30.01.	0.000	N
6.12 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	10'000.00	30.07.2015	30.01.2017	24 206 143		-	100.000	100.000	30.01.	0.000	N
9.6 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	01.02.2016	01.02.2017	24 206 337		-	100.000	100.000	01.02.	0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Crude Oil	USD	1'000.00	02.02.2016	02.02.2017	24 206 326		-	100.000	100.000	02.02.	7.810	Y
CPC with Participation auf ESTXSD30 EUR P	USD	1'000.00	04.02.2014	06.02.2017	22 829 401		-	97.400	100.000		0.000	Y
7 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	06.02.2015	06.02.2017	26 670 973		-	100.000	100.000	06.02.	0.000	N
6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.02.2015	06.02.2017	26 670 980		-	100.000	100.000	06.02.	0.000	N
7.2 % Reverse Convertible auf ams	CHF	1'000.00	07.08.2015	07.02.2017	25 141 656		-	100.000	100.000	07.02.	0.000	N
6.9 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.02.2016	08.02.2017	30 049 697		-	100.000	100.000	08.02.	0.000	Y
9 3/4 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	09.02.2016	09.02.2017	24 206 374		-	100.000	100.000	09.02.	0.000	Y
8.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.02.2015	13.02.2017	26 670 996		-	100.000	100.000	13.02.	0.000	N
5.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.02.2016	13.02.2017	30 463 274		-	100.000	100.000	13.02.	0.000	Y
7.2 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	15.02.2016	15.02.2017	30 463 246		-	100.000	100.000	15.02.	0.000	Y
5 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.02.2016	16.02.2017	24 206 393		-	100.000	100.000	16.02.	0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	20.02.2015	20.02.2017	26 671 015		-	100.000	100.000		0.000	Y
6.3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.02.2015	20.02.2017	26 671 027		-	100.000	100.000	20.02.	0.000	N
5.02 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.08.2015	20.02.2017	25 141 664		-	100.000	100.000	20.02.	0.000	N
5.28 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	20.08.2015	20.02.2017	24 206 177		-	100.000	100.000	20.02.	0.15966	N
2 % Underlying Tracker auf Indizes	CHF	1'000.00	22.02.2016	22.02.2017	30 463 286		-	100.000	100.000	22.02.	0.000	Y
Reverse Convertible auf The Swatch Grp	CHF	1'000.00	24.02.2016	24.02.2017	30 463 371		-	100.000	100.000		0.000	N
6.3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.02.2015	27.02.2017	26 671 051		-	100.000	100.000	27.02.	0.000	N
4.2 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	27.02.2015	27.02.2017	26 671 039		-	100.000	100.000	27.02.	0.000	N
10 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.03.2016	01.03.2017	30 463 337		-	100.000	100.000	01.03.	0.000	N
5.85 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	03.03.2016	03.03.2017	24 206 424		-	100.000	100.000	03.03.	0.000	Y
5 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.03.2015	06.03.2017	26 671 075		-	100.000	100.000	06.03.	0.000	N
6.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.03.2015	06.03.2017	26 671 070		-	100.000	100.000	06.03.	0.000	N
10 % Reverse Convertible auf Hugo Boss N	EUR	1'000.00	07.03.2016	07.03.2017	30 463 391		-	100.000	100.000	07.03.	0.000	Y
7 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.03.2016	09.03.2017	24 206 430		-	100.000	100.000	09.03.	0.000	Y
5.4 % Reverse Convertible auf Indizes	EUR	1'000.00	14.03.2016	14.03.2017	24 206 443		-	100.000	100.000	14.03.	0.000	Y
Reverse Convertible auf Nestle N	CHF	64.50	18.01.2016	15.03.2017	30 463 200		-	100.000	100.000		0.000	Y
8.71 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.03.2016	21.03.2017	24 206 447		-	100.000	100.000	21.03.	0.000	Y
5 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.03.2016	22.03.2017	24 206 450		-	100.000	100.000	22.03.	0.000	Y
Bonus Certificate auf SMI	CHF	1'000.00	24.03.2014	24.03.2017	22 829 493		-	99.370	100.000		0.000	Y
Kapitalschutz Zertifikat auf SMI	CHF	1'000.00	27.03.2013	27.03.2017	20 711 249		-	88.930	90.000		0.000	Y
Outperformance Certificate auf Mket Vect Gld Min	USD	1'000.00	27.03.2014	27.03.2017	22 829 545		-	97.090	100.000		0.000	Y
12.15 % Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	28.03.2016	29.03.2017	26 671 968		-	100.000	100.000	29.03.	7.876	Y
6.4 % Reverse Convertible auf Gold 1 Uz	USD	1'000.00	30.03.2016	30.03.2017	31 451 975		-	100.000	100.000	30.03.	8.060	Y
Callable Express Certificate auf Aktien	CHF	1'000.00	04.04.2014	04.04.2017	20 711 627		-	99.490	100.000		0.000	Y
7 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	06.10.2015	06.04.2017	26 671 735		-	100.000	100.000	06.04.	0.26751	N
Reverse Convertible auf UBS Group N	CHF	12.80	11.02.2016	06.04.2017	30 463 312		-	100.000	100.000		0.000	Y
5.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.04.2015	10.04.2017	26 671 197		-	100.000	100.000	10.04.	0.000	N
10 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.10.2015	12.04.2017	26 671 769		-	100.000	100.000	12.04.	0.000	N
17 % Reverse Convertible auf Aktien 11.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	13.04.2016	13.04.2017	26 672 029		-	100.000	100.000		0.000	N
5.1 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.04.2016	18.04.2017	26 672 038		-	100.000	100.000	18.04.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
2.52 % Reverse Convertible auf ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	18.04.2016	18.04.2017	26 672 031		-	100.000	100.000	18.01. 18.04.	0.000 0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	27.04.2015	27.04.2017	24 206 051		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	USD	1'000.00	27.04.2015	27.04.2017	24 206 053		-	98.480	100.000		0.000	Y
5.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.04.2015	27.04.2017	26 671 239		-	100.000	100.000	27.04.	0.000	N
3.81 % Barrier Reverse Convertible auf Indizes 28.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.04.2014	28.04.2017	20 711 655		-	100.000	100.000	28.04.	0.69816	N
Reverse Convertible auf Zurich Insur Grp N	CHF	1'000.00	02.02.2016	02.05.2017	30 463 260		-	100.000	100.000		0.000	Y
5.62 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.05.2016	02.05.2017	26 672 073		-	100.000	100.000	02.02. 02.05.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Gilead Sciences	USD	75.15	04.02.2016	03.05.2017	30 463 282		-	99.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Zurich Insur Grp N	CHF	202.00	08.05.2015	08.05.2017	26 671 316		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Holcim N 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	53.00	08.05.2015	08.05.2017	26 671 315		-	100.000	100.000		0.000	Y
5 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.05.2015	08.05.2017	26 671 283		-	100.000	100.000	08.05.	0.000	N
Reverse Convertible auf ABB N	CHF	14.30	08.05.2015	08.05.2017	26 671 317		-	100.000	100.000		0.000	Y
24.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.05.2016	10.05.2017	31 452 168		-	100.000	57.068	08.02. 10.05.	0.000 0.000	N
14 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien 9.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	12.05.2016	12.05.2017	26 672 090		-	100.000	100.000	10.01. 09.02. 09.03. 10.04. 12.05.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
5 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.05.2015	15.05.2017	26 671 299		-	100.000	100.000	15.05.	0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	EUR	1'000.00	15.05.2015	15.05.2017	24 206 075		-	99.800	100.000		0.000	Y
10.76 % (14.35 % p.a.) Reverse Convertible auf Crude Oil	CHF	1'000.00	17.08.2016	17.05.2017	33 506 645		-	100.000	100.000	17.05.	0.000	Y
Bonus Certificate auf Pfizer	USD	100.00	17.04.2014	26.05.2017	24 206 459		-	97.160	100.000		0.000	Y
6.8 % Reverse Convertible auf Galenica N	CHF	1'000.00	26.05.2016	26.05.2017	26 672 119		-	100.000	100.000	26.05.	0.000	Y
5.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.05.2015	29.05.2017	26 671 344		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	N
16 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien 27.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.05.2016	30.05.2017	26 672 132		-	100.000	100.000	27.02.	0.000	N
2.3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.06.2016	01.06.2017	26 672 151		-	100.000	100.000	01.06.	0.000	Y
Worst of Express Certificate auf Aktien 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.06.2014	06.06.2017	20 711 687		-	99.730	100.000		0.000	Y
8.4 % Reverse Convertible auf Bayer N	EUR	1'000.00	06.06.2016	06.06.2017	30 049 732		-	100.000	100.000	06.06.	0.000	Y
13.18 % Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	06.06.2016	06.06.2017	26 672 157		-	100.000	100.000	06.06.	8.190	Y
10 % Reverse Convertible auf Aktien 7.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.12.2015	07.06.2017	26 672 323		-	100.000	100.000	07.06.	0.000	N
5.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.06.2015	08.06.2017	26 671 399		-	100.000	100.000	08.06.	0.000	N
5 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.06.2015	08.06.2017	26 671 362		-	100.000	100.000	08.06.	0.000	N
8.51 % Reverse Convertible auf Ferrari 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	09.06.2016	09.06.2017	26 672 169		-	100.000	100.000		0.000	Y
6.68 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.06.2016	09.06.2017	26 672 170		-	100.000	100.000	09.06.	0.000	Y
6.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.12.2014	12.06.2017	25 141 852		-	100.000	100.000	12.06.	0.150	N
5.3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.06.2015	12.06.2017	26 671 386		-	100.000	100.000	12.06.	0.000	N
CPC with Participation auf IBEX 35	CHF	1'000.00	19.06.2014	19.06.2017	20 711 700		-	90.730	91.000		0.000	Y
Bonus Certificate auf MSCI Brazil	USD	1.00	19.06.2014	19.06.2017	24 206 628		-	97.230	100.000		0.000	Y
Capital Protection with Conditional Coupon auf Crude Oil	USD	1'000.00	19.06.2014	19.06.2017	24 206 624		-	93.540	96.200		0.000	Y
4 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	20.06.2016	20.06.2017	26 672 206		-	100.000	100.000	20.06.	0.000	Y
8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.06.2016	23.06.2017	32 581 121		-	100.000	100.000	23.03. 23.06.	0.000 0.000	N
6.1 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.12.2015	28.06.2017	30 463 116		-	100.000	100.000	28.06.	0.000	N
Underlying Tracker auf Zurich Insur Grp N 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	29.03.2016	29.06.2017	26 671 966		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Zurich Insur Grp N 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	29.03.2016	29.06.2017	26 671 965		-	100.000	100.000		0.000	Y
7 3/4 % Reverse Convertible auf Accor	CHF	1'000.00	30.06.2016	30.06.2017	26 672 253		-	100.000	100.000	30.06.	0.000	Y
3.64 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.07.2015	03.07.2017	26 671 454		-	100.000	100.000	03.07.	0.000	N
Bonus Certificate auf ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	03.06.2014	07.07.2017	24 206 582		-	97.270	100.000		0.000	Y
CPC with Participation auf IBEX 35	CHF	1'000.00	07.07.2014	07.07.2017	20 711 723		-	90.730	91.000		0.000	Y
6.43 % Reverse Convertible auf Aktien 9.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	11.10.2016	11.07.2017	32 951 227		-	99.000	100.000	09.01.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
11.18 % Reverse Convertible auf Aktien 9.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.10.2016	11.07.2017	32 951 228		-	99.000	100.000	09.01.	0.000	Y
11.66 % Reverse Convertible auf Aktien 9.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	11.10.2016	11.07.2017	32 951 225		-	99.000	100.000		0.000	Y
9.26 % Reverse Convertible auf Volkswagen Vz 9.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	11.10.2016	11.07.2017	32 951 226		-	99.000	100.000		0.000	Y
9 % Reverse Convertible auf Aktien 9.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	11.10.2016	11.07.2017	32 951 224		-	99.000	100.000		0.000	Y
10.14 % Reverse Convertible auf Aktien 9.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.10.2016	11.07.2017	32 951 229		-	99.000	100.000	09.01.	0.000	Y
12.04 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.07.2016	12.07.2017	26 672 285		-	100.000	100.000	12.07.	0.000	Y
4.4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.07.2015	17.07.2017	26 671 489		-	100.000	100.000	17.07.	0.69452	N
Reverse Convertible auf Vodafone Group	GBP	1.84	24.03.2016	20.07.2017	31 451 944		-	98.990	100.000		0.000	Y
5.39 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.07.2016	20.07.2017	26 672 306		-	100.000	100.000	20.07.	0.000	Y
7.3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.01.2016	21.07.2017	30 463 176		-	100.000	100.000	19.01. 21.07.	0.000 0.000	N
Worst of Express Certificate auf Aktien	USD	1'000.00	24.07.2014	24.07.2017	24 206 804		-	96.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Biogen 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	23.06.2016	24.07.2017	32 581 162		-	100.000	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate auf ESTX50 EUR P 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	19.06.2014	26.07.2017	24 206 645		-	96.810	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate auf Aktien	USD	1'000.00	28.07.2014	28.07.2017	24 206 808		-	96.660	100.000		0.000	Y
5.03 % Reverse Convertible auf Applied Materials	USD	1'000.00	28.07.2016	28.07.2017	31 452 216		-	100.000	100.000	28.07.	8.230	Y
5.83 % Reverse Convertible auf Amgen	USD	1'000.00	28.07.2016	28.07.2017	31 452 215		-	100.000	100.000	28.07.	8.230	Y
6.66 % Reverse Convertible auf Microsoft	USD	1'000.00	28.07.2016	28.07.2017	31 452 214		-	100.000	100.000	28.07.	8.230	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	31.07.2015	31.07.2017	26 671 524		-	100.000	100.000		0.000	Y
4 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.07.2015	31.07.2017	26 671 552		-	100.000	100.000	31.07.	0.000	N
4.2 % Reverse Convertible auf Indizes 30.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	01.02.2016	01.08.2017	30 049 698		-	100.000	100.000	30.01.	0.000	N
Reverse Convertible auf Richemont N	CHF	1'000.00	02.02.2016	02.08.2017	30 463 261		-	100.000	100.000		0.000	Y
9.44 % Reverse Convertible auf Tesla Motors 18.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	02.08.2016	02.08.2017	31 452 224		-	100.000	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible auf Aktien 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	04.08.2016	04.08.2017	32 581 352		-	100.000	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate auf Aktien	CHF	1'000.00	05.08.2014	07.08.2017	24 206 828		-	99.730	100.000		0.000	Y
9 % (4 1/2 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.08.2015	07.08.2017	26 671 566		-	100.000	100.000	07.08.	0.000	Y
6.2 % Reverse Convertible auf Aktien 2.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.08.2015	07.08.2017	24 206 161		-	100.000	100.000	02.02.	0.000	N
6 % Reverse Convertible auf LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	08.08.2016	08.08.2017	31 452 226		-	100.000	100.000	08.08.	0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Apple	USD	1'000.00	08.08.2016	08.08.2017	31 452 229		-	100.000	100.000	08.08.	8.490	Y
8 % Reverse Convertible auf Apple	USD	1'000.00	08.08.2016	08.08.2017	31 452 228		-	100.000	100.000	08.08.	8.490	Y
4.05 % Reverse Convertible auf Actelion N	CHF	1'000.00	10.08.2016	10.08.2017	32 581 332		-	100.000	100.000	10.08.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.02.2015	11.08.2017	26 671 002		-	100.000	100.000	09.02. 11.08.	0.000 0.000	N
Worst of Bonus Certificate auf Aktien 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	100.00	14.02.2014	14.08.2017	22 829 422		-	97.550	100.000		0.000	Y
4.9 % Barrier Reverse Convertible auf Rohstoffe	CHF	1'000.00	15.08.2014	15.08.2017	24 206 853		-	100.000	100.000	14.02. 12.05. 15.08.	0.200 0.200 0.200	N
5 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien 14.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	16.02.2016	16.08.2017	24 206 395		-	100.000	100.000	12.02.	0.000	N
8 % Reverse Convertible auf CS Group N	CHF	1'000.00	16.08.2016	16.08.2017	31 452 249		-	100.000	100.000	16.08.	0.000	Y
Express Certificate auf Fonds 17.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	21.08.2014	21.08.2017	22 829 639		-	96.920	100.000		0.000	Y
4.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.08.2015	21.08.2017	26 671 628		-	100.000	100.000	19.01. 17.02. 18.03. 21.04. 18.05. 19.06. 19.07. 21.08.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
4.46 % Reverse Convertible auf Allianz N	EUR	1'000.00	22.08.2016	22.08.2017	32 951 066		-	100.000	100.000	22.08.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4.36 % Reverse Convertible auf BASF N	EUR	1'000.00	22.08.2016	22.08.2017	32 951 067		-	100.000	100.000	22.08.	0.000	Y
4.82 % Reverse Convertible auf Bayer N	EUR	1'000.00	22.08.2016	22.08.2017	32 951 064		-	100.000	100.000	22.08.	0.000	Y
6.08 % Reverse Convertible auf Daimler N	EUR	1'000.00	22.08.2016	22.08.2017	32 951 063		-	100.000	100.000	22.08.	0.000	Y
4.44 % Reverse Convertible auf Heidelbergcement AG	EUR	1'000.00	22.08.2016	22.08.2017	32 951 065		-	100.000	100.000	22.08.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.08.2016	25.08.2017	33 506 646		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
Callable Express Certificate auf Fonds	CHF	1'000.00	29.08.2014	29.08.2017	22 829 655		-	99.730	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate auf Aktien	GBP	1'000.00	03.09.2014	29.08.2017	24 206 684		-	95.510	100.000		0.000	Y
7 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.02.2016	29.08.2017	30 463 323		-	100.000	100.000	23.02. 29.08.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	30.05.2016	30.08.2017	31 452 338		-	100.000	100.000		0.000	Y
Express Certificate auf Fonds 6.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.375%	USD	1'000.00	28.08.2014	04.09.2017	24 206 689		-	96.810	100.000		0.000	Y
5 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.09.2015	04.09.2017	26 671 647		-	100.000	100.000	03.03. 04.09.	0.000 0.000	N
5.26 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.03.2015	06.09.2017	26 671 059		-	100.000	100.000	03.03. 06.09.	0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.03.2015	06.09.2017	26 671 060		-	100.000	100.000	03.03. 06.09.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	915.90	08.09.2016	07.09.2017	33 506 729		-	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate auf Indizes	USD	1'000.00	08.09.2014	08.09.2017	25 141 454		-	96.630	100.000		0.000	Y
5.72 % Reverse Convertible auf Indizes 6.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.09.2015	11.09.2017	25 141 675		-	100.000	100.000		0.000	N
4.24 % Reverse Convertible auf Indizes 6.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.09.2015	11.09.2017	25 141 673		-	100.000	100.000	06.03.	0.000	N
10 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien 9.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.03.2016	11.09.2017	30 463 379		-	100.000	100.000	09.03.	0.000	N
Reverse Convertible auf CS Group N	CHF	1'000.00	11.03.2016	11.09.2017	31 451 894		-	100.000	100.000		0.000	Y
6.8 % Reverse Convertible auf Aktien 9.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.03.2016	11.09.2017	30 463 384		-	100.000	100.000	09.03.	0.000	N
Worst of Express Certificate auf Aktien 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	02.09.2014	15.09.2017	25 141 405		-	96.760	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Aktien 16.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.09.2015	18.09.2017	26 671 683		-	100.000	100.000	16.03.	0.000	N
6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.09.2015	18.09.2017	26 671 677		-	100.000	100.000	16.03. 18.09.	0.000 0.000	N
4.04 % Reverse Convertible auf Indizes 18.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.09.2015	18.09.2017	24 206 228		-	100.000	100.000	18.09.	0.000	N
9.2 % Reverse Convertible auf Aktien 16.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.03.2016	18.09.2017	31 451 880		-	100.000	100.000	16.03.	0.000	N
7.8 % Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	19.09.2016	19.09.2017	32 951 158		-	100.000	100.000	19.03. 19.06. 19.09.	2.391 2.337 2.310	N
7.9 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.09.2016	21.09.2017	33 506 728		-	100.000	100.000	21.09.	0.000	Y
4.8 % Reverse Convertible auf Actelion N	CHF	1'000.00	21.09.2016	21.09.2017	33 506 732		-	100.000	100.000	21.09.	0.000	Y
5.81 % (5.55 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.09.2016	22.09.2017	32 951 116		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	25.09.2015	25.09.2017	26 671 728		-	100.000	100.000		0.000	Y
4 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.09.2016	26.09.2017	33 970 655		-	100.000	100.000	26.09.	0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.09.2016	29.09.2017	32 951 194		-	100.000	100.000	29.09.	0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	04.04.2016	04.10.2017	31 451 983		-	100.000	100.000		0.000	Y
6.05 % Reverse Convertible auf CS Group N	CHF	1'000.00	05.10.2016	05.10.2017	32 951 205		-	100.000	100.000	05.10.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Aktien 6.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.10.2015	06.10.2017	26 671 740		-	100.000	100.000	30.03. 06.10.	0.000 0.000	N
8 % Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	06.10.2016	06.10.2017	32 951 210		-	100.000	100.000	06.10.	9.090	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	11.04.2016	11.10.2017	26 672 006		-	100.000	100.000		0.000	Y
12 % (8 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien 11.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	13.04.2016	13.10.2017	31 451 971		-	100.000	100.000		0.000	Y
4.76 % Reverse Convertible auf Indizes 12.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	16.10.2014	16.10.2017	22 829 708		-	100.000	100.000	12.01.	0.150	N
7 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien 13.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	15.04.2016	17.10.2017	31 451 992		-	100.000	100.000	13.04.	0.000	N

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
7 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien 13.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.07.2016	18.10.2017	32 581 216		-	100.000	100.000	13.01. 13.04. 13.07.	0.000 0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.10.2016	19.10.2017	32 951 255		-	100.000	100.000	19.10.	0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Adecco Group N	CHF	1'000.00	19.10.2016	19.10.2017	32 951 256		-	100.000	100.000	19.10.	0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	29.04.2016	20.10.2017	30 049 722		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 18.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	23.10.2015	23.10.2017	26 671 870		-	98.300	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.10.2015	23.10.2017	26 671 828		-	100.000	100.000	21.04. 23.10.	0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible auf Air Liquide	EUR	1'000.00	24.10.2016	24.10.2017	32 951 267		-	100.000	100.000	24.10.	0.000	Y
Underlying Tracker auf ESTX50 EUR P 29.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	25.04.2016	25.10.2017	26 672 047		-	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.10.2016	26.10.2017	33 970 748		-	100.000	100.000	26.10.	0.000	Y
14.7 % (9.8 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.04.2016	27.10.2017	31 452 059		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.10.2015	30.10.2017	26 671 860		-	100.000	100.000	27.04. 30.10.	0.000 0.000	N
9 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien 25.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	02.05.2016	02.11.2017	31 452 072		-	100.000	100.000	25.04.	0.000	N
7 % Reverse Convertible auf Aktien 4.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.11.2015	06.11.2017	26 671 879		-	100.000	100.000	04.05.	0.000	N
6.1 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.11.2015	13.11.2017	26 671 903		-	100.000	100.000	11.05. 13.11.	0.000 0.000	N
5.30 % Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	16.11.2016	16.11.2017	32 951 350		-	100.000	100.000	16.11.	9.830	Y
6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.11.2015	20.11.2017	26 671 929		-	100.000	100.000	18.05. 20.11.	0.000 0.000	N
5.2 % Reverse Convertible auf Indizes 18.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	20.05.2016	20.11.2017	31 452 170		-	100.000	100.000	18.05.	0.000	N
4.5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.11.2016	24.11.2017	33 970 704		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.05.2016	27.11.2017	31 452 309		-	100.000	100.000	27.02. 27.05. 27.08. 27.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
3.2 % Reverse Convertible auf Nestle N	CHF	1'000.00	01.12.2016	01.12.2017	33 506 819		-	100.000	100.000	01.12.	0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Total	EUR	1'000.00	01.12.2016	01.12.2017	33 506 821		-	100.000	100.000	01.12.	0.000	Y
4.68 % Reverse Convertible auf Indizes 2.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	04.12.2015	04.12.2017	24 206 296		-	100.000	100.000	02.03. 02.06.	0.000 0.000	N
15 3/4 % (10 1/2 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien 2.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.06.2016	06.12.2017	31 452 331		-	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Deutsche Bank N	EUR	1'000.00	07.12.2016	07.12.2017	33 970 505		-	100.000	100.000	07.12.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.12.2015	18.12.2017	26 672 377		-	100.000	100.000	15.06. 18.12.	0.000 0.000	N
8.85 % (5.9 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien 30.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	04.07.2016	04.01.2018	32 581 167		-	100.000	100.000		0.000	Y
10 1/2 % (7 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien 30.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	04.07.2016	04.01.2018	32 581 166		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien 23.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	15.07.2016	15.01.2018	26 672 292		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	19.07.2016	19.01.2018	26 672 302		-	98.810	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Deutsche Bank N 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	15.40	22.07.2016	22.01.2018	32 581 297		-	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Indizes 20.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	23.01.2015	23.01.2018	26 280 822		-	100.000	100.000		0.000	N
Underlying Tracker auf CS Group N	CHF	1'000.00	26.07.2016	26.01.2018	32 581 322	%	159.230	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Novartis N	CHF	1'000.00	05.02.2016	05.02.2018	24 206 368	%	123.770	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf CS Group N	CHF	1'000.00	09.08.2016	09.02.2018	32 581 346	%	158.890	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 10.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	12.02.2016	12.02.2018	30 463 201		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf The Swatch Grp	CHF	1'000.00	12.08.2016	12.02.2018	32 581 349	%	85.630	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf The Swatch Grp	CHF	1'000.00	16.08.2016	16.02.2018	33 506 641	%	89.480	100.000	100.000		0.000	Y
3.5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.02.2016	19.02.2018	30 463 197	%	99.740	100.000	100.000	20.02.	0.000	N

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible auf Aktien 16.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.08.2016	19.02.2018	32 951 061		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Volkswagen Vz	EUR	1'000.00	22.08.2016	22.02.2018	33 506 655	%	84.390	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.08.2016	22.02.2018	33 506 653	%	84.040	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf ABB N 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	26.02.2016	26.02.2018	24 206 417		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	26.02.2016	26.02.2018	30 463 313	%	134.940	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	23.08.2016	26.02.2018	33 245 826		-	100.000	100.000		0.000	Y
4 % Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	27.02.2015	27.02.2018	26 671 033	%	107.130	100.000	100.000	27.02.	0.000	N
3.52 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.09.2016	01.03.2018	30 049 757	%	101.050	100.000	100.000	01.03. 01.09.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf CS Group N	CHF	1'000.00	02.09.2016	02.03.2018	33 506 703	%	88.590	100.000	100.000		0.000	Y
Kapitalschutz-Zertifikat auf SMI 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.03.2013	07.03.2018	20 711 246		-	88.130	90.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Indizes 18.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.03.2016	12.03.2018	30 463 373		-	100.000	100.000		0.000	Y
4.8 % Reverse Convertible auf Aktien 9.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.03.2016	12.03.2018	30 463 388		-	100.000	100.000	09.03.	0.000	N
5.16 % Reverse Convertible auf Aktien 9.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	13.03.2015	13.03.2018	26 671 103		-	100.000	100.000	11.01. 09.02. 09.03.	0.000 0.000 0.000	N
7.27 % Reverse Convertible auf Aktien 9.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	13.09.2016	13.03.2018	32 951 141		-	100.000	100.000	09.03.	2.410	N
Reverse Convertible auf Aktien 14.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	16.09.2016	16.03.2018	32 951 153		-	100.000	100.000		0.000	Y
4 % Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	20.03.2015	20.03.2018	26 671 086	%	113.060	100.000	100.000	20.03.	0.000	N
Underlying Tracker auf Daihatsu Motor 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	23.03.2015	23.03.2018	26 671 142		-	100.000	100.000		0.000	Y
6.5 % Reverse Convertible auf Aktien 30.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.10.2015	06.04.2018	26 671 733		-	100.000	100.000	30.03.	0.350	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	10.04.2015	10.04.2018	26 671 129	%	10.660	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 10.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.825%	USD	1'000.00	12.10.2016	12.04.2018	33 970 738		-	98.470	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf IBEX 35	EUR	1'000.00	17.04.2015	17.04.2018	26 671 249	%	98.200	99.700	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	21.04.2016	23.04.2018	31 452 090		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Volkswagen Vz 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	26.04.2016	26.04.2018	31 452 104		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 25.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	27.04.2016	27.04.2018	31 452 122		-	100.000	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible auf Indizes 27.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.10.2015	30.04.2018	25 141 682		-	100.000	100.000	26.01. 27.04.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	26.04.2016	03.05.2018	31 452 103	%	94.740	100.000	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.05.2015	04.05.2018	26 671 256	%	101.500	100.000	100.000	31.10.	0.000	N
Reverse Convertible auf CS Group N	CHF	1'000.00	04.11.2016	04.05.2018	33 970 825	%	93.140	100.000	100.000		0.000	Y
Callable Express Certificate auf Aktien 3.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.068% 3.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	07.05.2014	07.05.2018	20 711 666		-	94.440	100.000		0.000	Y
3.2 % Reverse Convertible auf Indizes 8.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.05.2015	07.05.2018	26 671 244		-	100.000	100.000	08.05.	0.000	N
4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.05.2015	08.05.2018	26 671 278	%	73.400	100.000	100.000	04.05. 02.11.	0.000 0.000	N
5.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.05.2015	15.05.2018	26 671 304	%	101.270	100.000	100.000	15.05.	0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	16.11.2016	16.05.2018	33 970 868	%	109.430	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	16.11.2016	16.05.2018	33 970 867	%	114.070	100.000	100.000		0.000	Y
5.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.05.2015	22.05.2018	26 671 321	%	102.270	100.000	100.000	18.05. 20.11.	0.000 0.000	N
4 1/2 % Barrier Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.05.2014	23.05.2018	24 206 514	%	76.770	100.000	100.000	22.05. 22.11.	1.300 1.300	N
Reverse Convertible auf Tesla Motors 23.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	25.05.2016	25.05.2018	26 672 120		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 26.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	29.11.2016	29.05.2018	33 506 810		-	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
7.98 % Reverse Convertible auf Aktien	GBP	1'000.00	22.05.2015	30.05.2018	26 671 336	%	7.750	100.000	100.000	27.02. 25.05. 25.08. 27.11.	3.916 3.930 3.854 4.086	N
Reverse Convertible auf Aktien 29.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	24.10.2016	30.05.2018	33 970 780		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Indizes	CHF	1'000.00	04.12.2015	04.06.2018	26 672 315	%	114.900	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Barrier Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.06.2014	06.06.2018	24 206 565	%	76.240	100.000	100.000	05.06. 05.12.	0.900 0.900	N
9.4 % (4.7 % p.a.) Reverse Convertible auf Indizes 2.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.06.2016	06.06.2018	31 452 330		-	100.000	100.000	02.06.	0.000	Y
Underlying Tracker auf Novartis N	CHF	78.90	07.06.2016	07.06.2018	32 581 097	CHF	83.050	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Barrier Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.06.2014	13.06.2018	24 206 592	%	75.760	100.000	100.000	12.06. 12.12.	0.900 0.900	N
Underlying Tracker auf Basket	USD	1'000.00	15.06.2016	15.06.2018	26 672 198	%	113.860	98.200	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Novartis N	CHF	1'000.00	15.06.2016	15.06.2018	26 672 190	%	111.970	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.06.2016	18.06.2018	32 581 086	%	101.740	100.000	100.000	16.03. 15.06. 14.09. 14.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
5.4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.06.2015	19.06.2018	26 671 408	%	99.270	100.000	100.000	15.06. 15.12.	0.000 0.000	N
4 1/2 % Barrier Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.06.2014	20.06.2018	24 206 607	%	101.760	100.000	100.000	19.06. 19.12.	1.000 1.000	N
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.06.2016	20.06.2018	32 581 134	%	98.700	100.000	100.000		0.000	Y
9 1/2 % (4 3/4 % p.a.) Reverse Convertible auf Indizes 20.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	22.06.2016	22.06.2018	32 581 104		-	100.000	100.000	20.06.	0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	24.06.2016	22.06.2018	32 581 108	%	124.690	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	24.06.2016	22.06.2018	32 581 172		-	100.000	100.000		0.000	Y
5.4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.06.2015	26.06.2018	26 671 425	%	100.000	100.000	100.000	22.06. 22.12.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	500.00	27.06.2016	27.06.2018	26 672 231		-	100.000	100.000		0.000	Y
6.26 % Reverse Convertible Called for Red 24.03.2017 at 100% 24.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	28.06.2016	28.06.2018	26 672 247		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	N
CPC with Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	12.12.2013	29.06.2018	22 829 275	%	112.480	87.900	90.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf UBS Group N	CHF	1'000.00	29.06.2016	29.06.2018	26 672 251	%	119.440	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf CS Group N 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	12.81	29.06.2016	29.06.2018	32 581 198		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Orange	EUR	1'000.00	04.04.2016	04.07.2018	30 324 566	%	100.460	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf The Swatch Grp	CHF	1'000.00	06.07.2016	06.07.2018	32 581 235	%	81.010	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	06.07.2016	06.07.2018	32 581 231	%	87.430	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf SMI	CHF	1'000.00	19.04.2016	09.07.2018	31 452 083	%	106.140	92.871	95.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Aktien 5.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.07.2016	09.07.2018	32 581 187		-	100.000	100.000	06.01. 06.04. 06.07. 05.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	12.07.2016	12.07.2018	32 581 240	%	93.540	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Fonds	CHF	1'000.00	17.07.2015	17.07.2018	26 671 460	%	113.060	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	EUR	1'000.00	23.07.2015	23.07.2018	24 206 138	%	108.110	99.430	100.000		0.000	Y
10 % (4.99 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.07.2016	23.07.2018	32 581 270	%	108.300	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Barrier Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.07.2014	25.07.2018	24 206 757	%	79.960	100.000	100.000	24.01. 24.07.	0.950 0.950	N
Underlying Tracker auf Basket	USD	1'000.00	25.07.2016	25.07.2018	31 452 185	%	121.550	98.300	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.07.2015	31.07.2018	26 671 532	%	102.080	100.000	100.000	27.01. 27.07.	0.000 0.000	N
5 % Barrier Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.08.2014	06.08.2018	24 206 784	%	76.510	100.000	100.000	31.01. 31.07.	0.950 0.950	N

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.08.2015	06.08.2018	24 206 147	%	85.040	100.000	100.000	01.02. 02.08.	0.000 0.000	N
4.1 % Reverse Convertible auf Aktien 4.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.08.2015	07.08.2018	26 671 554		-	100.000	100.000	03.02. 04.08.	0.000 0.000	N
CPC with Participation auf SMI	CHF	1'000.00	12.02.2014	10.08.2018	22 829 375	%	111.300	87.810	90.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Swisscom N	EUR	1'000.00	08.08.2016	10.08.2018	31 452 252	%	109.980	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Aktien 8.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	10.08.2016	10.08.2018	32 581 327		-	100.000	100.000	08.02. 08.05. 08.08.	0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Zurich Insur Grp N 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	17.02.2016	17.08.2018	24 206 398		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Novartis N	CHF	1'000.00	17.02.2016	17.08.2018	30 463 339	%	96.590	100.000	100.000		0.000	Y
11.7 % (3.9 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.08.2015	21.08.2018	26 671 587	%	107.890	100.000	100.000		0.000	Y
13 1/2 % (4 1/2 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien 17.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	21.08.2015	21.08.2018	26 671 588		-	100.000	100.000		0.000	Y
5.1 % Barrier Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.08.2014	22.08.2018	24 206 854	%	83.460	100.000	100.000	21.02. 21.08.	0.850 0.850	N
Reverse Convertible auf Zurich Insur Grp N	CHF	1'000.00	22.02.2016	22.08.2018	30 463 341	%	99.420	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.08.2016	24.08.2018	33 506 626	%	103.640	100.000	100.000		0.000	Y
5.52 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.08.2015	27.08.2018	24 206 183	%	99.430	100.000	100.000	23.02. 26.05. 24.08. 23.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	29.02.2016	29.08.2018	24 206 418	%	94.560	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Zurich Insur Grp N 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	29.02.2016	29.08.2018	24 206 419		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf The Swatch Grp	CHF	1'000.00	29.02.2016	29.08.2018	30 463 374	%	95.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	29.02.2016	29.08.2018	30 463 375	%	124.140	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf UBS Group N	CHF	13.16	30.08.2016	30.08.2018	33 506 679	CHF	19.710	100.000	100.000		0.000	Y
14.6 % (4.87 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.09.2015	04.09.2018	26 671 631	%	111.560	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Barrier Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.09.2014	05.09.2018	25 141 409	%	81.280	100.000	100.000	06.03. 04.09.	0.750 0.750	N
Reverse Convertible auf Aktien 2.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	07.09.2016	07.09.2018	33 506 725		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf SMI	CHF	1'000.00	07.09.2016	07.09.2018	32 581 298	%	111.150	100.000	100.000		0.000	Y
11.7 % (3.9 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.09.2015	11.09.2018	26 671 668	%	108.530	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Aktien 14.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	16.09.2016	17.09.2018	33 506 710		-	100.000	100.000	15.03. 15.06. 14.09.	0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Novartis N	CHF	1'000.00	16.09.2016	17.09.2018	33 506 724	%	107.530	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate auf Aktien	EUR	1'000.00	18.09.2013	18.09.2018	20 712 063	%	80.390	92.830	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate auf Aktien	EUR	1'000.00	18.09.2013	18.09.2018	20 712 064	%	135.750	92.830	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate auf Aktien	USD	1'000.00	02.10.2013	19.09.2018	20 712 062	%	129.990	91.390	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate auf Aktien	USD	1'000.00	02.10.2013	19.09.2018	20 712 061	%	74.210	91.390	100.000		0.000	Y
4 % Barrier Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.09.2014	19.09.2018	25 141 467	%	103.200	100.000	100.000	17.03. 18.09.	0.800 0.800	N
Worst of Express Certificate auf Fonds 18.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	09.10.2013	25.09.2018	20 711 524		-	91.490	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.09.2014	26.09.2018	25 141 494	%	101.300	100.000	100.000	24.03. 25.09.	0.750 0.750	N
Reverse Convertible auf Aktien 18.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	GBP	1'000.00	01.04.2016	01.10.2018	31 525 617		-	97.860	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate auf Aktien	GBP	1'000.00	02.10.2013	02.10.2018	20 712 059	%	76.120	91.020	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate auf Aktien	GBP	1'000.00	02.10.2013	02.10.2018	20 712 060	%	138.830	91.020	100.000		0.000	Y
13 1/2 % (4 1/2 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.10.2015	02.10.2018	26 671 755	%	108.910	100.000	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.10.2014	03.10.2018	25 141 520	%	102.170	100.000	100.000	31.03. 01.10.	0.650 0.65361	N

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5 % Reverse Convertible auf Aktien 28.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.10.2015	05.10.2018	26 671 743		-	100.000	100.000	30.03. 28.09.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Indizes 6.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	08.04.2016	08.10.2018	26 672 003		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf The Swatch Grp	CHF	1'000.00	10.10.2016	10.10.2018	33 970 709	%	79.880	100.000	100.000		0.000	Y
9 % (3.6 % p.a.) Reverse Convertible auf Indizes 10.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	12.04.2016	12.10.2018	31 451 972		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf The Swatch Grp	CHF	1'000.00	12.10.2016	12.10.2018	33 970 735	%	79.800	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 13.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	17.10.2016	17.10.2018	32 951 243		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	18.10.2016	18.10.2018	32 951 252		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.04.2016	19.10.2018	31 452 053		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 19.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.04.2016	19.10.2018	31 452 067		-	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Aktien 26.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	28.10.2016	29.10.2018	33 970 755		-	100.000	100.000	26.01. 27.04. 27.07. 26.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf S&P GSCI Crd Oil ER	USD	1'000.00	30.10.2015	30.10.2018	26 671 891	%	80.850	97.090	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.10.2014	31.10.2018	25 141 626	%	83.680	100.000	100.000	27.04. 27.10.	0.550 0.550	N
Underlying Tracker auf Novartis N	CHF	1'000.00	31.10.2016	31.10.2018	30 049 787	%	112.080	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.11.2015	06.11.2018	26 671 892	%	102.640	100.000	100.000	04.05. 04.11.	0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.11.2015	06.11.2018	26 671 885	%	102.160	100.000	100.000	04.05. 04.11.	0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.11.2015	06.11.2018	26 671 876	%	102.620	100.000	100.000	04.05. 02.11.	0.000 0.000	N
4 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.11.2014	07.11.2018	25 141 758	%	101.470	100.000	100.000	07.11.	1.200	N
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.11.2014	07.11.2018	25 141 747	%	102.730	100.000	100.000	04.05. 03.11.	0.650 0.650	N
Reverse Convertible auf Aktien 5.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.11.2016	08.11.2018	32 951 320		-	100.000	100.000		0.000	Y
4.55 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.11.2014	12.11.2018	25 141 746	%	101.760	100.000	100.000	12.11.	1.100	N
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.11.2015	13.11.2018	26 671 899	%	101.900	100.000	100.000	11.05. 11.11.	0.000 0.000	N
5.3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.11.2014	14.11.2018	25 141 768	%	81.510	100.000	100.000	11.05. 10.11.	0.550 0.550	N
Reverse Convertible auf ArcelorMittal Reg 13.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	15.11.2016	15.11.2018	30 049 794		-	100.000	100.000		0.000	Y
5.1 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.11.2015	20.11.2018	26 671 922	%	102.710	100.000	100.000	18.05. 16.11.	0.000 0.000	N
4.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.11.2014	21.11.2018	25 141 798	%	100.990	100.000	100.000	21.11.	1.000	N
Underlying Tracker auf Richemont N	CHF	1'000.00	22.11.2016	22.11.2018	33 506 788	%	122.560	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	22.11.2016	22.11.2018	33 506 790	%	134.110	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf The Swatch Grp	CHF	1'000.00	22.11.2016	22.11.2018	33 506 789	%	122.810	100.000	100.000		0.000	Y
2.1 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.11.2016	26.11.2018	34 588 965	%	122.110	100.000	100.000	27.11.	0.000	N
6.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	10'000.00	03.06.2016	03.12.2018	31 452 311	%	102.050	100.000	100.000	02.03. 01.06. 31.08. 30.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.12.2014	05.12.2018	25 141 825	%	101.790	100.000	100.000	01.06. 01.12.	0.450 0.450	N
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.06.2016	10.12.2018	31 452 343	%	102.250	100.000	100.000	08.03. 09.06. 08.09. 07.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
6.1 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.12.2015	11.12.2018	26 672 347	%	102.980	100.000	100.000	09.06. 07.12.	0.000 0.000	N
5.4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.12.2015	18.12.2018	30 463 097	%	102.300	100.000	100.000	16.03. 15.06. 14.09. 14.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.12.2014	19.12.2018	25 141 874	%	102.180	100.000	100.000	19.12.	0.900	N
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.06.2016	27.12.2018	32 581 163	%	94.200	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 29.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	27.06.2016	27.12.2018	32 581 164		-	100.000	100.000		0.000	Y
Credit Linked Structured Note mit Referenzanleihe	CHF	1'000.00	31.10.2013	03.01.2019	20 712 197	%	99.340	100.000	100.000	03.01. 03.04. 03.07. 03.10.	2.811 2.750 2.780 2.811	N
Reverse Convertible auf Aktien 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	04.07.2016	04.01.2019	26 672 257		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf S&P 500	CHF	1'450.74	14.11.2016	07.01.2019	33 970 851	CHF	1481.910	100.000	100.000		0.000	Y
2.4 % Structured Note mit Kreditrisio auf SELECTA GROUP	CHF	1'000.00	10.12.2015	10.01.2019	26 672 340	%	101.600	100.000	100.000	24.03. 24.09. 24.12.	6.000 6.200 6.066	N
4 1/2 % Barrier Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.07.2014	11.01.2019	24 206 712	%	104.390	100.000	100.000	10.01. 10.07.	1.300 1.300	N
4 1/2 % Reverse Convertible auf Indizes 13.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	15.07.2016	15.01.2019	32 581 223		-	100.000	100.000	12.01. 13.04. 13.07.	0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf The Swatch Grp 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	28.07.2016	28.01.2019	31 452 195		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 26.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	28.07.2016	28.01.2019	32 581 329		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Zurich Insur Grp N 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	28.07.2016	28.01.2019	31 452 197		-	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Indizes 2.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	05.02.2016	05.02.2019	30 463 235		-	100.000	100.000	02.02.	0.000	N
5.1 % Reverse Convertible auf Aktien 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	28.08.2015	28.02.2019	26 671 613		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	N
Underlying Tracker auf The Swatch Grp	CHF	1'000.00	05.09.2016	05.03.2019	32 951 112	%	130.860	100.000	100.000		0.000	Y
CPC with Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	06.03.2014	06.03.2019	22 829 441	%	100.770	92.800	95.000		0.000	Y
4.8 % Reverse Convertible auf Indizes 2.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.03.2016	07.03.2019	30 463 359		-	100.000	100.000	02.03.	0.000	N
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.03.2015	13.03.2019	26 671 088	%	103.000	100.000	100.000	09.03. 11.09.	0.000 0.000	N
CPC with Participation auf SMI	CHF	1'000.00	25.03.2014	25.03.2019	22 829 495	%	108.860	87.700	90.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.03.2015	27.03.2019	26 671 153	%	96.060	100.000	100.000	27.03.	0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.09.2015	28.03.2019	24 206 239	%	94.890	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Daimler N	EUR	1'000.00	29.03.2016	29.03.2019	26 671 964	%	110.280	100.000	100.000		0.000	Y
4.9 % Reverse Convertible auf Indizes 30.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.03.2016	01.04.2019	31 451 943		-	100.000	100.000	30.03.	0.000	N
Floater with a Reference Bond on CHF 3m Libor	CHF	1'000.00	28.02.2014	03.04.2019	22 829 420	%	98.870	100.000	100.000	03.01. 03.04. 03.07. 03.10.	3.066 3.000 3.033 3.066	N
Floater with a Reference Bond on CHF 3m Libor	CHF	1'000.00	26.03.2014	03.04.2019	22 829 490	%	100.940	100.000	100.000	03.01. 03.04. 03.07. 03.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
CPN 2014-08-04-19 auf Swiss Balanced VolCap Strat	CHF	1'000.00	08.04.2014	08.04.2019	22 829 474	%	100.110		100.000		0.000	Y
4.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.04.2015	08.04.2019	26 671 166	%	100.930	100.000	100.000	30.03. 02.10.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Zurich Insur Grp N	EUR	1'000.00	12.10.2016	15.04.2019	32 951 232	%	119.180	100.000	100.000		0.000	Y
Capital Protection auf ESTX50 EUR P 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	24.04.2014	24.04.2019	20 711 650		-	87.150	95.000		0.000	Y
Capital Protection Certificate auf Index 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	30.04.2014	24.04.2019	20 711 651		-	87.260	95.000		0.000	Y
CPC with Participation auf Aktien	USD	1'000.00	25.04.2014	25.04.2019	24 206 468	%	104.610	91.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 20.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	25.10.2016	25.04.2019	32 951 270		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	29.04.2016	29.04.2019	26 672 059	%	114.170	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4.8 % Reverse Convertible auf Indizes 27.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	29.04.2016	29.04.2019	30 049 719		-	100.000	100.000	26.01. 27.04.	0.000 0.000	N
4 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.05.2015	06.05.2019	26 671 264	%	99.780	100.000	100.000	04.05. 02.11.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	26.05.2016	24.05.2019	31 452 337	%	106.190	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Novartis N	CHF	1'000.00	03.06.2016	03.06.2019	31 452 272	%	104.370	100.000	100.000		0.000	Y
4.3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.06.2015	05.06.2019	26 671 355	%	76.570	100.000	100.000	01.06. 04.12.	0.000 0.000	N
Protection Participation auf ESTXSD30 EUR P	USD	1'000.00	17.06.2016	17.06.2019	26 672 191	%	103.210	97.060	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	20.06.2016	20.06.2019	32 581 100	%	112.570	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.06.2015	26.06.2019	26 671 418	%	100.500	100.000	100.000	22.06. 22.12.	0.000 0.000	N
4 % Reverse Convertible auf Aktien 26.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	29.06.2016	28.06.2019	32 581 127		-	100.000	100.000	24.03. 26.06.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Indizes	CHF	1'000.00	29.06.2016	01.07.2019	30 049 737	%	113.790	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	01.07.2016	01.07.2019	26 672 266		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Barrick Gold	USD	1'000.00	01.07.2016	01.07.2019	32 581 203	%	71.140	97.640	100.000		0.000	Y
(1.85 % min.) Floored Floater with reference bond	CHF	1'000.00	17.04.2014	04.07.2019	22 829 583	%	100.340	100.000	100.000	04.01. 04.04. 04.07. 04.10.	4.625 4.625 4.625 4.625	N
Floored Floater on Gazprom	USD	1'000.00	03.04.2014	05.07.2019	22 829 534	%	100.180	100.000	100.000	05.01. 05.04. 05.07. 07.10.	10.712 10.416 10.133 10.615	N
Referenzschuldner-Zert. auf Index	USD	1'000.00	07.07.2014	05.07.2019	24 206 679	%	99.160	88.440	100.000		0.000	Y
Capital Protection auf Basket	CHF	1'000.00	11.07.2014	08.07.2019	22 829 542	%	99.400	88.620	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 19.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	22.07.2016	22.07.2019	30 049 743		-	100.000	100.000		0.000	Y
11 % (2 3/4 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.08.2015	07.08.2019	26 671 567	%	104.570	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.08.2016	15.08.2019	32 581 378	%	84.840	100.000	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate auf Fonds 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	19.08.2014	19.08.2019	24 206 850		-	91.510	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Apple 18.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	19.08.2016	19.08.2019	33 506 651		-	96.920	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf The Swatch Grp	CHF	1'000.00	26.08.2016	26.08.2019	30 049 754	%	145.410	100.000	100.000		0.000	Y
3.1 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.08.2015	28.08.2019	26 671 609	%	98.630	100.000	100.000	28.08.	0.000	N
Capital Protection Certificate auf STXE6Tel EUR P	EUR	1'000.00	08.09.2014	06.09.2019	25 141 459	%	101.180	97.590	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	14.09.2016	16.09.2019	33 506 750		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 22.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	26.09.2016	26.09.2019	32 951 189		-	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	03.10.2014	30.09.2019	24 206 650	%	96.760	89.060	90.000		0.000	Y
Floored Floater on Ref.Bond (Sony)	CHF	1'000.00	21.08.2014	04.10.2019	24 206 755	%	102.680	100.000	100.000	04.01. 04.04. 04.07. 04.10.	2.555 2.500 2.527 2.555	N
Structured Note auf 3.65 Western 18SrN	CHF	1'000.00	17.10.2014	04.10.2019	25 141 542	%	102.490	100.000	100.000	04.01. 04.04. 04.07. 04.10.	2.811 2.750 2.780 2.811	N
Underlying Tracker auf Gold 1 Uz 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	15.04.2016	14.10.2019	26 672 032		-	96.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.10.2016	14.10.2019	33 970 740	%	41.110	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	EUR	1'000.00	14.10.2016	14.10.2019	32 951 245	%	130.950	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	28.10.2016	28.10.2019	33 970 779	%	102.340	90.000	90.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf S&P 500	USD	1'000.00	21.11.2016	21.11.2019	33 970 880	%	120.870	95.860	100.000		0.000	Y
5.04 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.11.2015	27.11.2019	26 671 898	%	101.430	100.000	100.000	23.02. 26.05. 24.08. 23.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Structured Note auf Aktien	CHF	1'000.00	05.12.2014	05.12.2019	25 141 842	%	96.470	89.280	90.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Capital Protection Certificate on Equities	CHF	1'000.00	06.12.2013	06.12.2019	22 829 233	%	110.100	90.670	95.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Roche Hldg G	EUR	1'000.00	09.12.2016	09.12.2019	33 970 510	%	109.610	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf STXE6O&G EUR P	USD	1'000.00	15.12.2014	16.12.2019	25 141 879	%	103.470	91.690	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	USD	1'000.00	22.01.2016	22.01.2020	30 463 162	%	101.310	95.190	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	22.07.2016	22.01.2020	31 452 191	%	118.090	100.000	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.02.2016	17.02.2020	30 463 198	%	102.830	100.000	100.000	17.02.	0.000	N
Capital Protection Certificate auf Aktien	CHF	1'000.00	23.04.2014	03.04.2020	22 829 563	%	109.330	97.590	101.500		0.000	Y
Reverse Convertible auf Basket	USD	1'000.00	07.04.2015	07.04.2020	24 206 699	%	97.050	92.690	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf SMI	AUD	1'000.00	17.04.2015	17.04.2020	24 206 035	%	100.380	89.170	100.000		0.000	Y
Capital Protection Certificate auf Aktien	CHF	1'000.00	28.04.2014	24.04.2020	24 206 460	%	105.010	91.820	95.000		0.000	Y
Protection Participation auf SMI	CHF	1'000.00	30.04.2015	30.04.2020	26 671 230	%	97.290	93.000	93.000		0.000	Y
Capital Protection Certificate auf Aktien	CHF	1'000.00	15.05.2014	15.05.2020	24 206 494	%	106.040	91.810	95.000		0.000	Y
Structured Note auf Aktien	CHF	1'000.00	22.05.2015	22.05.2020	26 671 291	%	98.640	95.000	95.000		0.000	Y
CPC with Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	23.05.2014	25.05.2020	24 206 501	%	102.310	92.360	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	08.06.2015	08.06.2020	26 671 138	%	96.230	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Indizes	CHF	1'000.00	08.06.2015	08.06.2020	26 671 134	%	92.120	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.06.2015	08.06.2020	26 671 139	%	97.210	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.06.2015	08.06.2020	26 671 136	%	98.090	100.000	100.000		0.000	Y
4.37 % Reverse Convertible auf Aktien 20.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	22.06.2016	22.06.2020	26 672 215		-	100.000	100.000	19.01. 20.02. 20.03. 21.04. 18.05. 20.06.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
Worst of Express Certificate auf Indizes	EUR	1'000.00	09.07.2014	09.07.2020	24 206 745	%	98.430	95.050	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate auf Indizes	EUR	1'000.00	15.08.2014	09.07.2020	20 711 726	%	86.080	95.300	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	10.07.2015	10.07.2020	26 671 376	%	96.440	100.000	100.000		0.000	Y
CPC with Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	23.07.2014	23.07.2020	24 206 581	%	101.330	92.470	95.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate auf Fonds	GBP	1'000.00	28.07.2014	24.07.2020	24 206 686	%	112.380	87.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Basket 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.07.2015	27.07.2020	28 371 400		-	97.830	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	EUR	1'000.00	24.08.2016	24.08.2020	32 951 072	%	105.210	100.000	100.000		0.000	Y
CPC with Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	27.08.2014	27.08.2020	24 206 809	%	102.780	92.860	95.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	31.08.2015	28.08.2020	26 671 371	%	106.750	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	31.08.2015	28.08.2020	26 671 373	%	105.340	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	31.08.2015	28.08.2020	26 671 368	%	105.430	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Indizes 23.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	31.08.2015	28.08.2020	26 671 370		-	97.080	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 23.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	31.08.2015	28.08.2020	26 671 372		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Indizes	CHF	1'000.00	31.08.2015	28.08.2020	26 671 367	%	100.760	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.09.2015	04.09.2020	24 206 205	%	101.030	100.000	100.000	01.12.	0.000	Y
Underlying Tracker auf ESTX50 EUR P 29.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	21.09.2016	21.09.2020	33 506 772		-	100.000	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible auf CHF 10Y Swap	CHF	1'000.00	07.11.2014	22.09.2020	25 141 645	%	67.160	100.000	100.000	15.06.	30.416	N
Protection Participation auf SMI	CHF	1'000.00	26.09.2014	25.09.2020	25 141 551	%	102.980	88.030	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 26.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	28.09.2016	28.09.2020	30 049 772		-	100.000	100.000		0.000	Y
3 1/4 % Reverse Convertible auf Fonds	CHF	1'000.00	02.10.2015	02.10.2020	26 671 637	%	102.370	100.000	100.000	02.10.	0.000	N
CPC with Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	02.10.2014	06.10.2020	25 141 458	%	100.900	93.030	95.000		0.000	Y
(1.20 % min.) Structured Note mit Kreditrisiko auf Glencore Internat. var.	CHF	1'000.00	28.09.2015	12.10.2020	26 671 672	%	102.100	100.000	100.000	12.01. 12.04. 12.07. 12.10.	4.088 4.000 4.044 4.088	N
Protection Participation auf SMI	AUD	1'000.00	21.10.2016	21.10.2020	33 970 702	%	104.750	90.150	98.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	06.11.2014	06.11.2020	25 141 596	%	103.410	93.200	95.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	24.11.2014	24.11.2020	25 141 766	%	103.740	93.480	95.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	04.12.2015	04.12.2020	26 671 939	%	99.340	95.000	95.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	04.12.2015	04.12.2020	26 672 316	%	99.230	94.000	94.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	19.12.2014	18.12.2020	25 141 785	%	101.490	93.760	95.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	19.12.2014	18.12.2020	25 141 824	%	103.450	93.760	95.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	EUR	1'000.00	28.12.2015	28.12.2020	30 463 096	%	100.970	93.630	95.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
(min. 2 %) Structured Note mit Kreditrisiko auf ANHEUSER-BUSCH	AUD	1'000.00	20.11.2015	11.01.2021	26 671 917	%	97.450	100.000	100.000	23.03. 23.06. 25.09. 27.12.	3.792 3.748 4.020 3.964	N
Underlying Tracker auf 2.5 EIDG 36	CHF	1'000.00	08.02.2016	08.02.2021	30 463 250	%	97.750	100.000	100.000		0.000	Y
Structured Note auf Aktien	AUD	1'000.00	11.02.2015	11.02.2021	26 280 850	%	100.740	94.600	100.000	13.02.	11.520	N
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	04.03.2015	04.03.2021	26 671 008	%	101.030	95.000	95.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	EUR	92.60	04.08.2016	05.03.2021	32 581 295	CHF	115.780	100.000	100.000		0.000	Y
Structured Note auf Reference Bond	CHF	1'000.00	20.03.2015	16.04.2021	26 671 077	%	32.960	100.000	100.000	16.01. 17.04. 16.07. 16.10.	5.055 5.055 5.000 5.055	N
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	04.05.2015	03.05.2021	26 671 252	%	102.410	94.000	94.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	06.05.2016	06.05.2021	31 452 056	%	101.960	94.000	94.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	07.05.2015	07.05.2021	26 671 206	%	98.510	95.000	95.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	07.05.2015	07.05.2021	27 480 183	%	101.310	93.000	93.000		0.000	Y
Protection Participation 2015-31.05.21 auf Aktien	CHF	1'000.00	15.05.2015	17.05.2021	26 671 333	%	102.610	95.000	95.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	08.06.2015	08.06.2021	26 671 310	%	97.890	95.000	95.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf UBS Group N	CHF	1'000.00	30.06.2016	05.07.2021	32 581 207	%	153.010	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	07.07.2015	07.07.2021	26 671 350	%	98.010	93.000	93.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	07.07.2015	07.07.2021	26 671 397	%	97.780	95.000	95.000		0.000	Y
Structured Note auf Aktien	CHF	1'000.00	07.07.2016	12.07.2021	32 581 103	%	101.800	94.097	98.000		0.000	Y
Structured Note auf Equities	CHF	1'000.00	11.07.2016	12.07.2021	32 581 179	%	103.030	91.589	100.000	26.06.	4.790	Y
Underlying Tracker auf UBS Group N	CHF	1'000.00	12.07.2016	12.07.2021	32 581 239	%	160.660	100.000	100.000		0.000	Y
0.6 % Protection Participation auf Markit iTraxx Europe index	CHF	1'000.00	19.07.2016	12.07.2021	32 581 257	%	100.010	100.000	100.000	12.07.	5.883	N
Underlying Tracker auf CS Group N 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	09.08.2016	09.08.2021	31 452 248		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf UBS Group N 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	09.08.2016	09.08.2021	31 452 247		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf UBS Group N 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	23.08.2016	23.08.2021	32 951 068		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	25.08.2016	30.08.2021	33 506 678	%	169.720	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	07.09.2016	07.09.2021	33 506 723	%	145.790	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	20.09.2016	20.09.2021	33 506 769	%	142.830	100.000	100.000		0.000	Y
Structured Note	CHF	1'000.00	06.10.2014	06.10.2021	25 141 519	%	100.740	91.800	95.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf The Swatch Grp	CHF	1'000.00	03.11.2016	03.11.2021	33 970 821	%	132.730	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Basket 5.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	09.11.2016	09.11.2021	32 951 325		-	100.000	100.000		0.000	Y
Structured Note auf Aktien	CHF	1'000.00	10.11.2014	10.11.2021	25 141 595	%	100.000	92.060	95.000		0.000	Y
1.2 % Protection Participation auf Aktien	AUD	1'000.00	30.11.2015	30.11.2021	26 671 942	%	101.140	91.630	100.000	30.11.	8.940	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	04.12.2015	03.12.2021	26 671 938	%	99.300	95.000	95.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	USD	92.60	04.08.2016	07.12.2021	32 581 358	CHF	109.970	94.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.12.2014	17.12.2021	25 141 801	%	101.220	92.900	95.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	21.12.2015	21.12.2021	26 672 363	%	101.070	94.000	94.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	28.12.2015	27.12.2021	26 672 366	%	99.650	95.000	95.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	06.11.2015	10.01.2022	26 671 732	%	89.200	78.572	100.000	23.12.	16.729	Y
Reverse Convertible auf Basket 11.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.442%	EUR	1'000.00	13.01.2016	13.01.2022	24 206 319		-	97.810	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	18.01.2016	18.01.2022	30 463 142	%	100.070	95.000	95.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	28.01.2016	28.01.2022	30 463 251	%	99.280	90.000	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 8.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.713%	EUR	1'000.00	10.02.2016	10.02.2022	30 324 374		-	98.870	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	26.02.2016	28.02.2022	30 463 317	%	100.750	95.000	95.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	07.05.2015	09.05.2022	27 480 185	%	97.830	95.000	95.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	07.07.2016	07.07.2022	32 581 102	%	99.480	95.000	95.000		0.000	Y
1 % Structured Note mit Kreditrisiko auf iTraxx Series 23	CHF	1'000.00	20.10.2015	11.07.2022	26 671 764	%	100.310	100.000	100.000	11.01. 11.04. 11.07. 11.10.	2.555 2.500 2.527 2.555	N
4 % Structured Note mit Kreditrisiko auf iTraxx Series 23	CHF	1'000.00	20.10.2015	11.07.2022	26 671 765	%	99.660	100.000	100.000	11.01. 11.04. 11.07. 11.10.	9.677 9.466 9.571 9.677	N

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
1 1/2 % Structure Note on Basket	CHF	1'000.00	07.10.2016	11.07.2022	33 506 749	%	86.560	88.460	100.000	11.07.	12.140	Y
Protection Participation auf Basket	CHF	1'000.00	14.04.2015	13.07.2022	26 671 188	%	102.670	97.400	100.000	23.06.	5.000	N
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	09.08.2016	09.08.2022	32 581 275	%	98.810	94.000	94.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien 18.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	26.08.2016	26.08.2022	32 951 087		-	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf SMI	CHF	1'000.00	07.10.2016	07.10.2022	33 506 675	%	101.600	93.000	93.000		0.000	Y
Protection Participation auf Basket	CHF	1'000.00	06.11.2015	11.10.2022	28 371 601	%	102.250	93.080	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 4.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.10.2016	11.10.2022	32 951 223		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 25.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	28.10.2016	28.10.2022	32 951 244		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf UBS Group N 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	21.11.2016	21.11.2022	33 506 780		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 22.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	10.11.2016	22.11.2022	32 951 328		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 22.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	10.11.2016	22.11.2022	32 951 327		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 20.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	22.11.2016	22.11.2022	33 506 793		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	10.11.2016	23.11.2022	32 951 332		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf CS Group N 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	23.11.2016	23.11.2022	33 506 796		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 22.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	24.11.2016	24.11.2022	33 506 801		-	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf SMI	CHF	1'000.00	25.11.2016	25.11.2022	33 970 747	%	102.430	93.000	93.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 23.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	28.11.2016	28.11.2022	33 506 809		-	100.000	100.000		0.000	Y
1.1 % Structured Note auf Lafarge Holcim	CHF	1'000.00	05.11.2015	10.01.2023	26 671 822	%	100.120	100.000	100.000	27.12.	11.275	N
1 % Structured Note on Holcim 17 VRN SR	CHF	1'000.00	01.04.2016	10.01.2023	31 451 899	%	100.000	100.000	100.000	10.01. 10.04. 10.07. 11.10.	2.500 2.500 2.500 2.527	N
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	22.02.2016	22.02.2023	30 463 284	%	103.040	94.000	94.000		0.000	Y
Capital Protection on Equities 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.10.2013	30.10.2023	20 712 177		-	85.660	100.000		0.000	Y
Capital Protection auf Basket	CHF	1'000.00	27.12.2013	27.12.2023	20 712 101	%	110.860	92.330	108.000		0.000	Y
Kapitalschutz-Zertifikat mit Partizipation auf Strategy	CHF	1'000.00	08.04.2014	09.04.2024	22 829 444	%	105.530		100.000		0.000	Y
Kapitalschutz-Zertifikat auf MEFV Strategy	CHF	1'000.00	08.04.2014	09.04.2024	22 829 329	%	93.410	100.000	100.000		0.000	Y
Autocallable Protection Certificate auf Aktien 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	12.05.2014	10.05.2024	24 206 477		-	71.290	80.000		0.000	Y
"reine Differenzbesteuerung" Kapitalschutz-Zertifikat auf Strategy	CHF	1'000.00	10.06.2014	10.06.2024	24 206 480	%	106.180		100.000		0.000	Y
Autocallable Capital Protection with Coupon auf Aktien	CHF	1'000.00	11.07.2014	08.07.2024	22 829 538	%	103.160	90.450	100.000		0.000	Y
Autocallable Capital Protection with Coupon auf Aktien	CHF	1'000.00	11.07.2014	08.07.2024	22 829 539	%	105.120	81.400	90.000		0.000	Y
Autocallable Protection Certificate auf Aktien	CHF	1'000.00	11.07.2014	08.07.2024	22 829 540	%	104.890	72.360	80.000		0.000	Y
Capital Protection with Cap auf Aktien	CHF	1'000.00	11.07.2014	08.07.2024	22 829 541	%	105.870	94.060	104.000		0.000	Y
Autocallable Capital Protection with Coupon auf Aktien 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	25.07.2014	26.07.2024	24 206 771		-	81.720	90.000		0.000	Y
Autocallable Capital Protection with Coupon auf Aktien	CHF	1'000.00	03.10.2014	30.09.2024	24 206 648	%	100.610	82.950	90.000		0.000	Y
Autocallable Protection Certificate auf Aktien	CHF	1'000.00	03.10.2014	30.09.2024	24 206 647	%	100.360	73.730	80.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1.00	22.12.2014	20.12.2024	25 141 858	%	97.500	85.280	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.01.2015	31.12.2024	25 141 433	%	95.540	76.110	80.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	05.01.2015	31.12.2024	25 141 422	%	94.600	76.110	100.000		0.000	Y
10 % p.a. Multi Reverse Convertible 2014-31.12.24 auf Aktien	CHF	1'000.00	05.01.2015	31.12.2024	24 206 873	%	78.120	96.630	100.000	31.12.	5.000	Y
Autocallable Capital Protection with Coupon auf Aktien	CHF	1'000.00	05.01.2015	31.12.2024	25 141 435	%	103.300	95.140	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	10.03.2015	14.03.2025	25 141 861	%	102.690	98.120	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	10.03.2015	14.03.2025	25 141 863	%	92.710	78.490	80.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2017		IUP
								Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	
Protection Participation on Swiss Balanced Strategy	CHF	1'000.00	07.04.2015	07.04.2025	26 671 107	%	101.110	98.193	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf SMI	CHF	1'000.00	07.05.2015	07.05.2025	27 480 184	%	100.180	91.340	93.000		0.000	Y
Protection Participation auf SMI	CHF	1'000.00	20.05.2015	11.07.2025	26 671 247	%	102.350	91.870	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Swiss Balanced Strategy	CHF	1'000.00	24.07.2015	11.07.2025	26 671 273	%	99.200		100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	31.03.2016	31.03.2026	30 463 188	%	119.460	98.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	31.03.2016	31.03.2026	30 463 189	%	113.300	98.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 23.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	31.03.2016	31.03.2026	30 463 190		-	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	USD	1'000.00	28.04.2016	27.04.2026	31 452 016	%	88.700	67.309	80.000		0.000	Y
2.70 % p.a. Reverse Convertible on CHF 30Y Swap	CHF	1'000.00	12.11.2014	22.09.2026	25 141 464	%	81.440	100.000	100.000	15.03.	6.750	N
										15.06.	6.900	
										15.09.	6.900	
										15.12.	6.825	

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Raiffeisen Schweiz Genossenschaft, St. Gallen, Schweiz												
6 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien 26.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	26.06.2015	26.06.2017	26 671 422		-	100.000	100.000	26.06.	0.000	N
5.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.12.2015	28.06.2017	30 463 122		-	100.000	100.000	28.06.	0.000	N
5.10 % Reverse Convertible auf Basket	CHF	1'000.00	03.07.2015	03.07.2017	26 671 456		-	100.000	100.000	03.07.	0.000	N
6 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.01.2016	11.07.2017	30 463 136		-	100.000	100.000	09.01. 11.07.	0.000 0.000	N
5.91 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.07.2016	20.07.2017	26 672 307		-	100.000	100.000	20.01. 20.04. 20.07.	0.000 0.000 0.000	N
Worst of Express Certificate auf Aktien	USD	1'000.00	04.08.2014	25.07.2017	22 829 359		-	96.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 27.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	27.04.2016	27.07.2017	31 452 123		-	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.01.2016	28.07.2017	30 463 211		-	100.000	100.000	26.01. 28.07.	0.000 0.000	N
10.3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.08.2016	04.08.2017	31 452 234		-	100.000	100.000	02.02. 04.08.	0.000 0.000	N
5.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.08.2015	07.08.2017	26 671 560		-	100.000	100.000	03.02. 07.08.	0.000 0.000	N
7.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.02.2016	11.08.2017	30 463 270		-	100.000	100.000	09.02. 11.08.	0.000 0.000	N
7 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.08.2015	14.08.2017	26 671 574		-	100.000	100.000	10.02. 14.08.	0.000 0.000	N
2 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.08.2015	21.08.2017	26 671 586		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	N
Reverse Convertible auf ABB N	CHF	19.67	30.08.2016	29.08.2017	33 506 680		-	100.000	100.000		0.000	N
Reverse Convertible auf The Swatch Grp	CHF	1'000.00	08.09.2016	08.09.2017	33 506 722		-	100.000	90.000		0.000	N
6.45 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.10.2016	05.10.2017	33 506 770		-	100.000	100.000	05.04. 05.10.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Swisscom N	CHF	421.91	14.10.2016	06.10.2017	33 970 708		-	100.000	100.000		0.000	N
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.10.2015	16.10.2017	26 671 787		-	100.000	100.000	12.01. 13.04. 13.07. 16.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
7.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.04.2016	20.10.2017	31 452 029		-	100.000	100.000	20.04. 20.10.	0.000 0.000	N
7 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.10.2015	23.10.2017	26 671 830		-	100.000	100.000	21.04. 23.10.	0.000 0.000	N
5.19 % (6.92 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.01.2017	25.10.2017	33 874 273		-	100.000	100.000	25.10.	0.000	Y
1.57 % (2.61 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.03.2017	27.10.2017	33 874 413		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
4 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	5'000.00	30.10.2015	30.10.2017	26 671 852		-	100.000	100.000	30.10.	0.000	N
5.21 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.11.2016	01.11.2017	32 951 298		-	100.000	100.000	01.02. 01.05. 01.08. 01.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
5.15 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.11.2016	01.11.2017	32 951 300		-	100.000	100.000	01.02. 01.05. 01.08. 01.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
5.1 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.11.2016	01.11.2017	32 951 299		-	100.000	100.000	01.02. 01.05. 01.08. 01.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
7.9 % Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	02.05.2016	02.11.2017	26 672 074		-	100.000	100.000	01.05. 02.11.	4.323 4.339	N
7.1 % Reverse Convertible auf Aktien 3.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.05.2016	06.11.2017	31 452 114		-	100.000	100.000	03.05.	0.000	N
10 % Reverse Convertible auf Aktien 2.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	05.08.2016	06.11.2017	32 581 307		-	100.000	100.000	01.02. 03.05. 02.08.	0.000 0.000 0.000	N
4.2 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	13.05.2016	13.11.2017	31 452 161		-	100.000	100.000	13.05. 13.11.	0.000 0.000	N
6 % Reverse Convertible auf Aktien 11.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	15.08.2016	15.11.2017	32 581 341		-	100.000	100.000	13.02. 11.05. 11.08.	0.000 0.000 0.000	N

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
12 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.05.2017	22.11.2017	34 412 280		-	100.000	100.000	22.08. 22.11.	0.000 0.000	N
6.3 % Reverse Convertible auf Aktien 26.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	27.11.2015	27.11.2017	26 671 947		-	100.000	100.000	 26.05.	 0.000	N
6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.11.2015	27.11.2017	26 671 950		-	100.000	100.000	27.11.	0.000	N
7.2 % Reverse Convertible auf Aktien 24.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	26.08.2016	27.11.2017	33 506 629		-	100.000	100.000	24.02. 25.05. 24.08.	2.396 2.314 2.295	N
12 % (8 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.06.2016	06.12.2017	31 452 332		-	100.000	100.000	06.12.	0.000	Y
6.3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.12.2015	11.12.2017	26 672 352		-	100.000	100.000	09.06. 11.12.	0.000 0.000	N
4.64 % Reverse Convertible auf LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	15.12.2016	15.12.2017	33 874 129		-	100.000	100.000	15.12.	0.000	Y
4 % Reverse Convertible auf Indizes 18.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung 18.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.12.2014	18.12.2017	25 141 857		-	100.000	100.000	15.06. 18.12.	0.150 0.1425	N
6.9 % Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	19.12.2016	19.12.2017	33 874 139		-	100.000	100.000	19.12.	11.060	Y
7 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.12.2016	22.12.2017	33 874 157		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
4.74 % Reverse Convertible auf Indizes	USD	1'000.00	27.12.2016	27.12.2017	33 874 171		-	100.000	100.000	27.12.	11.760	Y
3 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	28.12.2016	29.12.2017	34 411 584		-	100.000	100.000	29.12.	0.000	Y
6.25 % Reverse Convertible auf Lonza Grp N	CHF	1'000.00	29.12.2016	29.12.2017	33 874 186		-	100.000	100.000	29.12.	0.000	Y
7.7 % Reverse Convertible auf Aktien 30.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	01.07.2016	04.01.2018	32 581 146		-	100.000	100.000	30.03. 30.06.	1.978 1.902	N
8.35 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.07.2016	04.01.2018	26 672 265	%	101.600	100.000	100.000	30.03. 30.06. 02.10.	0.000 0.000 0.000	N
7.7 % Reverse Convertible auf Aktien 3.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.12.2016	04.01.2018	33 874 178		-	100.000	100.000	31.03. 03.07.	0.000 0.000	N
7.5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.07.2016	05.01.2018	32 581 158	%	100.520	100.000	100.000	05.01. 05.07.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.01.2017	10.01.2018	34 411 537	%	110.960	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf AB InBev	EUR	1'000.00	12.01.2017	12.01.2018	33 874 195	%	99.670	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	15.01.2016	15.01.2018	30 463 127	%	126.360	100.000	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.07.2016	15.01.2018	32 581 230	%	101.650	100.000	100.000	15.01. 15.04. 15.07. 15.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
11 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.01.2017	17.01.2018	33 874 216	%	99.930	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.01.2016	22.01.2018	30 463 170	%	102.670	100.000	100.000	19.01. 20.07.	0.000 0.000	N
6.5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.01.2017	23.01.2018	33 874 246	%	99.880	100.000	100.000		0.000	Y
7.5 % Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	24.01.2017	24.01.2018	33 874 261	%	106.870	100.000	100.000		0.000	Y
6.5 % Reverse Convertible auf Aktien 20.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	25.07.2016	25.01.2018	32 581 287		-	100.000	100.000	19.01. 21.04. 20.07.	0.000 0.000 0.000	N
6.00 % (6.016713 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.01.2017	26.01.2018	34 411 657	%	105.560	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Indizes	USD	1'000.00	30.01.2017	30.01.2018	34 411 650	%	99.740	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Indizes	USD	1'000.00	02.02.2017	02.02.2018	34 411 692	%	99.760	100.000	100.000		0.000	Y
10.25 % Reverse Convertible auf Aktien 27.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.02.2017	06.02.2018	34 411 693		-	100.000	100.000	27.04. 27.07.	0.000 0.000	N
5.9 % Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	16.02.2017	16.02.2018	33 874 360	%	99.960	100.000	100.000		0.000	Y
3.5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.02.2017	27.02.2018	33 874 378	%	100.080	100.000	100.000		0.000	Y
4.8 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	01.03.2016	01.03.2018	30 463 338	%	101.270	100.000	100.000	01.03. 01.09.	0.000 0.000	N
7.25 % Reverse Convertible auf Aktien 31.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	02.09.2016	02.03.2018	33 506 658		-	100.000	100.000	02.03. 31.05. 31.08.	0.000 0.000 0.000	N
3 % Reverse Convertible auf Basket	CHF	1'000.00	06.03.2017	06.03.2018	33 873 628	%	100.270	100.000	100.000	06.06. 06.09. 06.12.	0.000 0.000 0.000	N

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.03.2017	09.03.2018	33 874 408	%	104.470	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf UBS Group N	CHF	1'000.00	09.03.2017	09.03.2018	33 874 409	%	104.580	100.000	100.000		0.000	Y
7.5 % Reverse Convertible auf Aktien 14.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	16.09.2016	16.03.2018	33 506 705		-	100.000	100.000	14.03. 14.06. 14.09.	0.000 0.000 0.000	N
3.1 % Reverse Convertible auf Indizes	EUR	1'000.00	27.03.2015	27.03.2018	20 711 474	%	100.680	100.000	100.000	27.03.	1.391	N
5 % Reverse Convertible auf ABB N	CHF	1'000.00	03.04.2017	03.04.2018	33 874 490	%	104.530	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf ARYZTA N	CHF	1'000.00	03.04.2017	03.04.2018	33 874 489	%	104.590	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Givaudan N	CHF	1'000.00	03.04.2017	03.04.2018	33 874 491	%	104.670	100.000	100.000		0.000	Y
6.1 % Reverse Convertible auf Gemalto	EUR	1'000.00	04.04.2017	04.04.2018	33 874 498	%	105.600	100.000	100.000		0.000	Y
18.35 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.07.2017	05.04.2018	37 155 298	%	86.660	100.000	100.000	05.10.	0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien 9.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	14.12.2016	06.04.2018	33 874 128		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.10.2016	12.04.2018	33 970 736	%	89.990	100.000	100.000		0.000	Y
5.21 % Reverse Convertible auf Aktien 12.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	14.10.2016	13.04.2018	33 970 745		-	100.000	100.000	11.01. 09.02. 09.03. 11.04. 11.05. 09.06. 12.07.	0.80825 0.84835 0.86001 0.85353 0.8536 0.82247 0.81735	N
3 % Reverse Convertible auf Indizes 13.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	17.04.2015	17.04.2018	26 671 207		-	100.000	100.000	13.04. 13.10.	0.000 0.000	N
12 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.04.2017	18.04.2018	34 412 140	%	102.340	100.000	100.000	14.07. 16.10.	0.000 0.000	N
6.75 % Reverse Convertible auf Aktien 18.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	03.10.2016	20.04.2018	33 506 752		-	100.000	100.000	18.01. 20.04. 18.07. 18.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
3.6 % Reverse Convertible auf Aktien 23.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	25.10.2016	25.04.2018	32 951 268		-	100.000	100.000	23.01. 21.04. 21.07. 23.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	30.10.2015	30.04.2018	26 671 850	%	122.710	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	30.10.2015	30.04.2018	26 671 849	%	131.290	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	29.04.2016	30.04.2018	31 452 048	%	132.260	100.000	100.000		0.000	Y
10.1 % Reverse Convertible auf ArcelorMittal Reg	USD	1'000.00	04.05.2017	04.05.2018	33 874 573	%	108.600	100.000	100.000		0.000	Y
7.8 % Reverse Convertible auf TechnipFMC Rg	USD	1'000.00	04.05.2017	04.05.2018	33 874 576	%	103.660	100.000	100.000		0.000	Y
5.8 % Reverse Convertible auf UBS Group N	USD	1'000.00	04.05.2017	04.05.2018	33 874 578	%	100.560	100.000	100.000		0.000	Y
7.1 % Reverse Convertible auf BT Group Rg	USD	1'000.00	04.05.2017	04.05.2018	33 874 575	%	102.680	100.000	100.000		0.000	Y
5.2 % Reverse Convertible auf Orange	USD	1'000.00	04.05.2017	04.05.2018	33 874 574	%	103.660	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Aktien 2.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.05.2015	08.05.2018	26 671 284		-	100.000	100.000	04.05. 02.11.	0.000 0.000	N
10 % (5 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien 9.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.05.2016	11.05.2018	31 452 125		-	100.000	100.000		0.000	Y
9.9 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.05.2017	11.05.2018	34 411 873	%	101.000	100.000	100.000	09.06. 06.07. 08.08. 08.09. 06.10. 08.11. 07.12.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
11.5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.05.2017	16.05.2018	34 411 881		n.v.	100.000	100.000	13.06. 13.07. 11.08. 13.09. 13.10. 13.11. 13.12.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
9.4 % Reverse Convertible auf Aktien 14.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	17.05.2017	17.05.2018	34 411 888		-	100.000	100.000	14.06. 13.07. 14.08.	0.000 0.000 0.000	N
3.4 % Reverse Convertible auf Indizes 18.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	22.05.2015	22.05.2018	26 671 334		-	100.000	100.000	18.05.	0.000	N
Underlying Tracker auf LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	24.01.2017	23.05.2018	33 874 276	%	107.460	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	26.01.2017	23.05.2018	33 874 284	%	105.070	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Exxon Mobil Rg	USD	73.16	01.03.2017	29.05.2018	34 411 826	CHF	76.590	98.310	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible auf Swisscom N	CHF	5'000.00	29.05.2017	29.05.2018	34 411 915	%	102.640	100.000	100.000		0.000	Y
5.2 % Reverse Convertible auf Aktien 8.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	12.12.2016	12.06.2018	34 588 986		-	100.000	100.000	09.03. 09.06. 08.09.	0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Givaudan N	CHF	1'000.00	14.03.2017	13.06.2018	33 874 416	%	133.640	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Indizes	CHF	1'000.00	15.06.2016	15.06.2018	26 672 197	%	110.740	100.000	100.000		0.000	Y
5.5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.06.2016	18.06.2018	31 452 367	%	101.490	100.000	100.000	16.03. 15.06. 14.09. 14.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
6.1 % Reverse Convertible auf Aktien 15.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.06.2015	19.06.2018	26 671 406		-	100.000	100.000	15.06. 15.12.	0.000 0.000	N
7 % Reverse Convertible auf Aktien 15.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	20.06.2016	20.06.2018	32 581 109		-	100.000	100.000	15.03. 15.06.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	20.03.2017	20.06.2018	33 874 440	%	130.830	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Aktien 20.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	22.12.2016	22.06.2018	34 411 521		-	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf SMI	CHF	1'000.00	23.12.2016	22.06.2018	34 411 540	%	120.280	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Aktien 28.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	28.12.2016	28.06.2018	33 874 175		-	100.000	100.000	24.03. 26.06. 26.09. 28.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien 29.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	29.12.2016	03.07.2018	33 874 187		-	100.000	100.000		0.000	Y
2.64 % (2.65 % p.a.) Reverse Convertible auf Clariant N	CHF	1'000.00	06.07.2017	06.07.2018	37 155 279	%	101.200	100.000	100.000		0.000	Y
4.2 % Reverse Convertible auf Richemont	CHF	1'000.00	06.07.2017	06.07.2018	37 155 277	%	101.070	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	16.01.2017	16.07.2018	33 874 204	%	122.070	100.000	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.07.2015	17.07.2018	26 671 484	%	100.210	100.000	100.000	17.07.	0.000	N
3.7 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.07.2017	17.07.2018	34 412 057	%	99.270	100.000	100.000		0.000	Y
10.50 % (7 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien 16.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.01.2017	19.07.2018	34 411 659		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 17.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.01.2017	19.07.2018	33 874 240		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Royal Dutch Shell-A	CHF	1'000.00	24.04.2017	19.07.2018	33 874 534	%	125.340	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 18.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	20.01.2017	20.07.2018	34 411 660		-	100.000	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	23.07.2015	23.07.2018	25 141 651	%	102.460	100.000	100.000	20.01. 20.07.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.04.2017	25.07.2018	34 412 204	%	72.500	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 26.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.996%	USD	1'000.00	30.01.2017	30.07.2018	33 874 293		-	98.010	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.07.2015	31.07.2018	26 671 527	%	98.630	100.000	100.000	31.07.	0.000	N
Worst of Express Certificate auf Aktien	GBP	1'000.00	06.08.2014	06.08.2018	24 206 675	%	53.510	92.570	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.08.2016	08.08.2018	31 452 235		-	100.000	100.000	02.02. 04.05. 04.08.	0.000 0.000 0.000	N
4.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
4.6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.08.2017	10.08.2018	37 155 335	%	100.340	100.000	100.000		0.000	Y
4.3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.08.2016	15.08.2018	32 581 336		-	100.000	100.000	09.02. 11.05. 10.08.	0.000 0.000 0.000	N
10.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
4 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	16.02.2015	16.08.2018	26 670 958		-	100.000	100.000	14.02. 14.08.	0.000 0.000	N
14.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
4.84 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	10'000.00	17.08.2017	17.08.2018	37 155 347	%	100.020	100.000	100.000		0.000	Y
4.13 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.08.2017	21.08.2018	37 155 355	%	100.310	100.000	100.000		0.000	Y
6.65 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.08.2016	22.08.2018	32 951 070		-	100.000	100.000	20.02. 18.05.	0.000 0.000	N
18.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Underlying Tracker auf Schneider Electric	CHF	1'000.00	24.02.2017	24.08.2018	33 874 377	%	109.510	100.000	100.000		0.000	Y
7.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.08.2016	27.08.2018	33 506 631		-	100.000	100.000	23.02. 26.05. 24.08.	0.000 0.000 0.000	N
24.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
3.2 % Reverse Convertible Called for red. on 24.11.17 at 100%	CHF	1'000.00	28.08.2015	28.08.2018	26 671 639		-	100.000	100.000	24.02. 26.05. 26.08. 24.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
24.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Reverse Convertible auf The Swatch Grp I	CHF	1'000.00	28.02.2017	28.08.2018	34 411 825	%	73.180	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.09.2016	03.09.2018	33 506 665		-	100.000	100.000	02.03. 01.06. 31.08.	0.000 0.000 0.000	N
31.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.03.2017	03.09.2018	34 411 803	%	106.380	100.000	100.000		0.000	Y
11.8 % (3.93 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.09.2015	04.09.2018	26 671 627	%	95.350	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.03.2017	10.09.2018	34 411 849	%	103.630	100.000	100.000		0.000	Y
4.5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.09.2015	18.09.2018	26 671 691	%	100.710	100.000	100.000	18.09.	0.000	N
3.5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.09.2014	19.09.2018	25 141 477	%	102.670	100.000	100.000	19.09.	1.600	N
7 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.09.2017	21.09.2018	37 155 452	%	100.990	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	09.03.2017	24.09.2018	34 411 848	%	106.880	100.000	100.000		0.000	Y
5.1 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.09.2015	25.09.2018	26 671 712		-	100.000	100.000	23.03. 21.09.	0.000 0.000	N
21.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
5.3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.09.2015	25.09.2018	26 671 708		-	100.000	100.000	23.03. 21.09.	0.000 0.000	N
21.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
(1.2 % min.) Floored Floater with reference bond	CHF	1'000.00	16.07.2013	04.10.2018	20 711 967	%	98.340	100.000	100.000	04.01. 04.04. 04.07. 04.10.	3.066 3.000 3.033 3.066	N
Credit Linked Structured Note auf Referenzanleihe	EUR	1'000.00	19.09.2013	04.10.2018	20 712 043	%	99.990	100.000	100.000	04.01. 04.04. 04.07. 06.10.	4.933 4.805 4.984 5.393	N
Credit Linked Structured Note mit Referenzanleihe	CHF	1'000.00	19.09.2013	04.10.2018	20 712 042	%	99.950	100.000	100.000	04.01. 04.04. 06.07. 06.10.	3.833 3.750 3.875 3.916	N
4.5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.10.2017	04.10.2018	37 155 485	%	97.000	100.000	100.000		0.000	Y
4.3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.10.2017	05.10.2018	38 089 652	%	101.400	100.000	100.000		0.000	Y
5.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.10.2015	09.10.2018	26 671 768		-	100.000	100.000	06.04. 05.10.	0.000 0.000	N
5.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
4.1 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.10.2014	10.10.2018	25 141 552	%	101.390	100.000	100.000	07.04. 09.10.	0.550 0.550	N

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.10.2014	17.10.2018	25 141 579	%	102.270	100.000	100.000	18.04. 16.10.	0.600 0.600	N
Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	18.04.2017	17.10.2018	34 412 171	%	103.170	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf STXE6 EUR P	CHF	1'000.00	18.04.2017	18.10.2018	33 873 637	%	101.920	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Indizes	CHF	1'000.00	19.05.2017	19.10.2018	34 412 281	%	95.130	95.000	95.000		0.000	Y
Protection Participation auf SMI	CHF	1'000.00	19.10.2017	19.10.2018	37 155 716	%	96.860	90.000	90.000		0.000	Y
7.2 % Reverse Convertible auf Aktien 19.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	21.10.2016	22.10.2018	33 970 712		-	100.000	100.000	19.01. 21.04. 20.07. 19.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Crude Oil	USD	1'000.00	22.09.2017	22.10.2018	38 089 452	%	106.690	98.470	100.000		0.000	Y
11.5 % Reverse Convertible auf Hertz Global Hldgs	CHF	1'000.00	24.07.2017	24.10.2018	37 155 309	%	105.580	100.000	100.000	20.10.	0.000	N
Underlying Tracker auf ESTXBnk EUR P	CHF	1'000.00	26.04.2017	26.10.2018	34 412 145	%	107.450	100.000	100.000		0.000	Y
5.1 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.10.2015	30.10.2018	26 671 853	%	102.200	100.000	100.000	27.04. 26.10.	0.000 0.000	N
4.4 % Reverse Convertible auf Indizes 27.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	02.05.2016	02.11.2018	31 452 088		-	100.000	100.000	26.01. 27.04.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	227.25	14.09.2017	12.11.2018	38 089 474	CHF	228.700	100.000	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible auf Indizes 11.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	13.11.2015	13.11.2018	26 671 908		-	100.000	100.000	11.05.	0.000	N
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.05.2017	15.11.2018	34 412 217	%	93.180	100.000	100.000	11.08. 13.11.	0.000 0.000	N
6.6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.05.2017	19.11.2018	34 412 239	%	97.980	100.000	100.000	17.08. 16.11.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	USD	1'000.00	19.05.2017	19.11.2018	34 411 890	%	118.950	97.780	100.000		0.000	Y
5.6 % Reverse Convertible auf Indizes 18.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	20.11.2015	20.11.2018	26 671 927		-	100.000	100.000	18.05.	0.27216	N
4.6 % Reverse Convertible auf Indizes 18.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	20.11.2015	20.11.2018	24 206 265		-	100.000	100.000	16.02. 18.05.	0.000 0.000	N
8.28 % Reverse Convertible auf Aktien 24.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	28.11.2016	28.11.2018	34 588 966		-	100.000	100.000	26.05. 24.11.	0.000 0.000	N
3.6 % Reverse Convertible auf Indizes 2.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	04.12.2015	04.12.2018	26 672 332		-	100.000	100.000	02.06.	0.000	N
5.56 % Reverse Convertible auf Indizes 31.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	04.12.2015	04.12.2018	24 206 294		-	100.000	100.000	02.03. 31.05.	0.000 0.000	N
6.8 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	06.06.2017	06.12.2018	34 412 288	%	93.660	100.000	100.000	31.08. 01.12.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.06.2017	07.12.2018	34 412 353	%	104.260	100.000	100.000		0.000	Y
5.5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.12.2014	12.12.2018	25 141 844	%	102.850	100.000	100.000	09.06. 08.12.	0.400 0.400	N
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.06.2017	12.12.2018	34 412 360	%	107.100	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Muenchener Rueckv N	EUR	156.94	13.06.2017	13.12.2018	34 412 362	CHF	189.680	100.000	100.000		0.000	Y
4.4 % Reverse Convertible auf Indizes 15.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	17.06.2016	17.12.2018	32 581 089		-	100.000	100.000	15.03. 15.06.	0.000 0.000	N
3 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	18.12.2015	18.12.2018	26 672 364	%	101.810	100.000	100.000	18.12.	0.000	N
4.2 % Reverse Convertible auf Indizes 22.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	24.06.2016	21.12.2018	32 581 119		-	100.000	100.000	22.03. 22.06.	0.000 0.000	N
1.754875 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.12.2016	21.12.2018	34 411 567	%	93.560	100.000	100.000	21.12.	0.000	N
7.5 % Reverse Convertible auf Aktien 19.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung 19.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	23.12.2016	24.12.2018	34 411 520		-	100.000	100.000	19.06. 19.12.	0.000 0.000	N
6.5 % Reverse Convertible auf Aktien 19.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	23.12.2016	24.12.2018	34 411 526		-	100.000	100.000	17.03. 19.06. 19.09. 19.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	10'000.00	23.12.2016	24.12.2018	34 411 528	%	98.450	100.000	100.000	17.03. 19.06. 19.09. 19.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
6.5 % Reverse Convertible auf Aktien 19.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	23.12.2016	24.12.2018	34 411 527		-	100.000	100.000	17.03. 19.06. 19.09. 19.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Protection Participation auf SMI	CHF	1'000.00	27.12.2017	27.12.2018	38 648 764	%	99.020	95.590	95.590		0.000	Y
5.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.12.2015	28.12.2018	30 463 110	%	102.670	100.000	100.000	22.06. 21.12.	0.000 0.000	N
Capital Protected Floater auf Referenzanleihe	CHF	1'000.00	20.12.2013	03.01.2019	22 829 263	%	100.500	100.000	100.000	03.01. 03.04. 03.07. 03.10.	4.472 4.375 4.423 4.472	N
0.5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.07.2016	04.01.2019	32 581 209	%	89.680	100.000	100.000	04.01.	0.000	Y
Credit Linked Note auf ITRAXX XOVER Series 20	CHF	1'000.00	29.11.2013	09.01.2019	20 712 236	%	107.040	100.000	100.000	09.01.	26.500	N
4.5 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	15.01.2016	15.01.2019	30 463 157	%	102.040	100.000	100.000	12.01. 13.07.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien 16.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.01.2017	18.01.2019	33 874 225		-	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.01.2015	23.01.2019	26 280 830	%	104.100	100.000	100.000	19.01. 20.07.	0.000 0.000	N
5.8 % Reverse Convertible auf Aktien 26.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	28.01.2015	28.01.2019	26 280 837		-	100.000	100.000	26.01. 26.04. 26.07.	0.000 0.000 0.000	N
6.24 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.01.2016	28.01.2019	30 463 245	%	99.220	100.000	100.000	28.01. 28.04. 28.07. 28.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
5.1 % Reverse Convertible auf Indizes 27.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	29.01.2016	29.01.2019	30 463 203		-	100.000	100.000	26.01. 27.07.	0.000 0.000	N
5.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.01.2015	30.01.2019	26 670 941	%	103.680	100.000	100.000	26.01. 27.07.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf ARYZTA N	CHF	1'000.00	06.02.2017	06.02.2019	33 874 315	%	132.410	100.000	100.000		0.000	Y
0.50 % p.a. Kapitalschutz-Zertifikat auf Aktien	CHF	1'000.00	04.02.2014	11.02.2019	22 829 286	CHF	1054.000	93.143	100.000	13.02.	6.050	Y
4.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.02.2016	11.02.2019	30 463 273	%	103.800	100.000	100.000	09.02. 09.08.	0.000 0.000	N
5.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.02.2015	13.02.2019	26 670 994	%	85.470	100.000	100.000	09.02. 10.08.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf The Swatch Grp I	CHF	338.94	14.11.2017	14.02.2019	38 649 111	CHF	343.500	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Merck Rg	USD	54.95	19.10.2017	15.02.2019	38 089 719	CHF	50.620	97.920	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.02.2017	18.02.2019	34 411 747	%	99.270	100.000	100.000	16.05. 16.08. 16.11.	0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.02.2017	20.02.2019	34 411 784	%	87.010	100.000	100.000		0.000	Y
Autocallable Capital Protection with Coupon auf Aktien	CHF	100.00	21.02.2014	21.02.2019	22 829 390	CHF	102.100	97.200	100.000		0.000	Y
4.8 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	22.02.2016	22.02.2019	30 463 294	%	102.270	100.000	100.000	16.02. 17.08.	0.000 0.000	N
5.7 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.02.2015	27.02.2019	26 671 052	%	78.840	100.000	100.000	27.02.	0.000	N
Underlying Tracker auf The Swatch Grp I	CHF	1'000.00	27.02.2017	27.02.2019	33 874 367	%	117.220	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.11.2017	28.02.2019	38 649 200	%	71.280	100.000	100.000		0.000	Y
4.6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.09.2017	04.03.2019	37 155 676	%	98.820	98.900	100.000	30.11.	0.000	Y
Reverse Convertible auf Celgene Corp Rg	USD	82.25	03.11.2017	05.03.2019	38 649 084	CHF	82.240	97.830	100.000		0.000	Y
3 % Underlying Tracker auf Indizes	CHF	1'000.00	06.03.2017	06.03.2019	34 411 778	%	114.520	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.10.2017	02.04.2019	38 089 627	%	84.490	100.000	100.000		0.000	Y
(2.125 % min.) Floored Floater (20.03.19) with reference bond	CHF	1'000.00	14.02.2014	03.04.2019	22 829 377	%	99.820	100.000	100.000	03.01. 03.04. 03.07. 03.10.	5.430 5.312 5.371 5.430	N

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	10.10.2017	10.04.2019	37 155 497	%	105.280	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.10.2017	16.04.2019	38 089 639	%	97.390	100.000	100.000		0.000	N
7 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.04.2017	18.04.2019	34 412 127	%	100.760	100.000	100.000	14.07. 16.10.	0.000 0.000	N
6.4 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	18.10.2017	18.04.2019	37 155 714	%	97.130	100.000	100.000		0.000	N
Underlying Tracker auf Nestle N	CHF	1'000.00	18.04.2017	26.04.2019	33 874 532	%	108.940	100.000	100.000		0.000	Y
4.4 % (2.19 % p.a.) Reverse Convertible auf Indizes	EUR	1'000.00	26.04.2017	30.04.2019	34 412 206	%	101.510	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	26.04.2017	30.04.2019	34 412 205	%	101.460	100.000	100.000		0.000	Y
3.6 % Reverse Convertible auf Aktien 27.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	02.05.2016	02.05.2019	26 672 072		-	100.000	100.000	27.01. 27.04.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf SMI	CHF	1'000.00	06.05.2016	06.05.2019	31 452 097	%	126.910	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	08.05.2017	08.05.2019	34 412 231	%	98.880	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	08.05.2017	08.05.2019	33 873 640	%	101.990	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.11.2017	09.05.2019	38 649 108	%	63.840	100.000	100.000		0.000	Y
2 1/4 %Capital Protection Certificate on Equities	AUD	1'000.00	13.05.2014	13.05.2019	24 206 496	CHF	826.700	93.970	100.000	15.05.	16.732	N
4.3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.05.2017	15.05.2019	34 412 218	%	96.390	100.000	100.000	11.08. 13.11.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	18.05.2017	15.05.2019	34 411 877	%	101.980	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	17.05.2017	17.05.2019	34 412 277	%	97.930	100.000	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible auf Aktien 17.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	20.05.2016	20.05.2019	31 452 165		-	100.000	100.000	16.02. 18.05. 17.08.	0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	23.05.2017	23.05.2019	34 412 302	%	97.590	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	24.05.2017	24.05.2019	34 412 305	%	99.120	100.000	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.06.2016	07.06.2019	26 672 163	%	104.580	100.000	100.000	07.06. 07.12.	0.000 0.000	N
5.5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.06.2017	07.06.2019	34 412 292	%	98.970	100.000	100.000	31.08. 01.12.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	07.06.2017	07.06.2019	34 412 352	%	98.420	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	19.12.2016	19.06.2019	33 873 594	%	131.930	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	19.06.2017	19.06.2019	34 411 959	%	96.290	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	19.06.2017	19.06.2019	34 411 966	%	99.340	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 26.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	29.12.2016	28.06.2019	33 874 181		-	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible auf Aktien 29.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	01.07.2016	01.07.2019	32 581 142		-	100.000	100.000	29.03. 29.06.	0.000 0.000	N
2.6 % Reverse Convertible auf Aktien 29.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	01.07.2016	01.07.2019	31 452 361		-	100.000	100.000	29.03. 29.06.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf ABB N	EUR	1'000.00	30.12.2016	02.07.2019	34 411 585	%	123.430	100.000	100.000		0.000	Y
4.5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.07.2017	03.07.2019	34 412 398	%	97.550	100.000	100.000	29.09.	0.000	N
0.5% (p.a.) Kapitalschutz-Zertifikat mit Coupon 2014-04.07.2019 auf Basket	CHF	1'000.00	25.04.2014	04.07.2019	22 829 581	%	102.420	96.870	100.000	18.04.	5.000	Y
Credit Linked Structured Note auf Referenzanleihe	CHF	1'000.00	16.05.2014	04.07.2019	24 206 492	%	100.370	100.000	100.000	04.01. 04.04. 04.07. 04.10.	2.811 2.750 2.780 2.811	N
5.2 % Reverse Convertible auf Aktien 5.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.07.2016	08.07.2019	32 581 180		-	100.000	100.000	06.01. 06.04. 06.07. 05.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
2 % Structured Note auf 6.5 Glencore 19EMTN	CHF	1'000.00	20.04.2016	11.07.2019	31 452 004	%	101.800	100.000	100.000	23.03. 23.06. 23.09. 23.12.	5.000 5.000 5.000 5.000	N
Underlying Tracker auf Deutsche Bank N	EUR	1'000.00	16.01.2017	16.07.2019	33 874 203	%	102.150	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	18.01.2017	18.07.2019	33 874 226	%	113.630	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	18.01.2017	18.07.2019	33 874 224	%	111.820	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	19.01.2017	19.07.2019	33 874 236	%	110.560	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
6 % Reverse Convertible auf Aktien 19.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	22.07.2016	22.07.2019	32 581 248		-	100.000	100.000	20.01. 21.04. 20.07. 19.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.07.2015	24.07.2019	26 671 507	%	77.350	100.000	100.000	20.01. 20.07.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	EUR	1'000.00	24.01.2017	24.07.2019	33 874 270	%	108.900	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	25.07.2017	25.07.2019	33 873 661	%	132.840	100.000	100.000		0.000	Y
7.5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.07.2017	26.07.2019	37 155 384	%	97.880	100.000	100.000	24.10.	0.000	N
3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.01.2016	29.07.2019	24 206 350	%	101.510	100.000	100.000	29.07.	0.000	N
4.5 % Reverse Convertible auf Indizes 3.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	05.08.2016	05.08.2019	32 581 316		-	100.000	100.000	02.02. 04.05. 03.08.	0.000 0.000 0.000	N
7.22 % Reverse Convertible auf Aktien 31.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	05.08.2016	05.08.2019	31 452 236		-	100.000	100.000	31.01. 02.03. 30.03. 02.05. 31.05. 29.06. 31.07.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
4 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	10.02.2017	09.08.2019	34 411 707	%	99.900	100.000	100.000	08.05. 08.08. 08.11.	0.000 0.000 0.000	N
4 % Reverse Convertible auf Indizes 14.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	16.08.2016	16.08.2019	33 506 644		-	100.000	100.000	14.02. 12.05. 14.08.	0.000 0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible auf Aktien 17.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.08.2016	19.08.2019	32 581 372		-	100.000	100.000	16.02. 17.05. 17.08.	0.000 0.000 0.000	N
4.75 % Reverse Convertible auf Aktien 23.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	26.08.2016	26.08.2019	33 506 627		-	100.000	100.000	23.02. 24.05. 24.08. 23.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
4 % Reverse Convertible auf Indizes 7.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	09.09.2016	09.09.2019	33 506 681		-	100.000	100.000	08.03. 09.06. 08.09. 07.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.03.2015	27.09.2019	26 671 144	%	96.650	100.000	100.000	23.03. 25.09.	0.000 0.000	N
8.5 % Reverse Convertible auf Aktien 28.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.09.2016	30.09.2019	33 506 756		-	100.000	100.000	28.03. 28.06. 28.09.	0.000 0.000 0.000	N
3 % Reverse Convertible auf Basket 4.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.10.2016	07.10.2019	33 970 657		-	100.000	100.000	04.04. 04.10.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Philip Mrrs Int	USD	1'000.00	07.10.2016	07.10.2019	32 951 211	%	109.190	96.940	100.000		0.000	Y
4.5 % Reverse Convertible auf Indizes 5.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.10.2016	07.10.2019	33 506 771		-	100.000	100.000	05.01. 04.04. 05.07. 05.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
4.2 % Reverse Convertible auf Aktien 4.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.10.2016	07.10.2019	33 970 656		-	100.000	100.000	04.04. 04.10.	0.000 0.000	N
7 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.10.2017	11.10.2019	37 155 503	%	97.100	100.000	100.000		0.000	N
Reverse Convertible auf CS Group N	CHF	1'000.00	13.10.2016	14.10.2019	33 970 741	%	84.550	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf S&P GSCI Crd Oil ER	USD	1'000.00	14.10.2016	14.10.2019	33 970 705	%	103.920	96.630	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.10.2016	14.10.2019	33 970 683		-	100.000	100.000	12.01. 12.04. 12.07. 12.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
12.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
4.5 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	21.10.2016	21.10.2019	33 970 711		-	100.000	100.000	20.01. 21.04. 19.07. 19.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
19.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
4.85 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.10.2017	30.10.2019	38 089 694	%	97.180	100.000	100.000		0.000	N
3 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	11.11.2016	14.11.2019	33 970 768		-	100.000	100.000	09.05. 09.11.	0.000 0.000	N
9.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Underlying Tracker auf ESTXBnk EUR P	CHF	136.27	19.05.2017	19.11.2019	34 412 253	CHF	130.000	100.000	100.000		0.000	Y
6.00 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.11.2016	25.11.2019	33 970 864		-	100.000	100.000	23.02. 23.05. 23.08. 23.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
23.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
5.25 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.11.2017	27.11.2019	38 649 125	%	99.070	100.000	100.000		0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	28.11.2017	28.11.2019	38 089 564	%	97.570	100.000	100.000		0.000	Y
4.50 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	02.12.2016	02.12.2019	33 970 893		-	100.000	100.000	02.03. 31.05. 30.08. 30.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
30.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
4.5 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	16.12.2016	16.12.2019	34 411 508	%	100.400	100.000	100.000	14.03. 14.06. 14.09. 14.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.12.2016	16.12.2019	34 411 506		-	100.000	100.000	14.03. 14.06. 14.09. 14.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
14.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
3.25 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.12.2016	23.12.2019	34 411 535		-	100.000	100.000	21.03. 21.06. 21.09. 21.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
21.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung 21.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Structured Note auf 6.5 Trans 20 SrN	CHF	1'000.00	28.11.2014	03.01.2020	25 141 786	%	100.620	100.000	100.000	03.01. 03.04. 03.07. 03.10.	6.388 6.250 6.319 6.388	N
4.1 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.07.2016	22.01.2020	32 581 241		-	100.000	100.000	19.01. 21.04. 20.07. 19.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
19.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
4 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	22.07.2016	22.01.2020	32 581 253		-	100.000	100.000	20.01. 21.04. 20.07.	0.000 0.000 0.000	N
20.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Underlying Tracker auf Nestle N	CHF	1'000.00	06.02.2017	06.02.2020	33 874 325	%	115.250	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	USD	1'000.00	23.02.2015	24.02.2020	26 671 011	%	111.210	91.640	100.000		0.000	Y
3.25 % Reverse Convertible auf Indizes	EUR	1'000.00	13.10.2017	13.04.2020	38 089 645	%	96.880	100.000	100.000		0.000	N
CPC with Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	28.04.2014	08.05.2020	22 829 582	%	106.850	96.520	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate auf Aktien	GBP	1'000.00	15.05.2014	15.05.2020	24 206 500	%	97.920	87.450	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf PIMCO Income E	USD	1'000.00	16.05.2017	18.05.2020	34 412 274	%	97.550	94.840	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Indizes	EUR	1'000.00	19.05.2017	19.05.2020	34 412 282	%	94.900	95.000	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	08.06.2015	08.06.2020	26 671 137	%	94.800	100.000	100.000		0.000	Y
4.72 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.06.2016	09.06.2020	26 672 142		-	100.000	100.000	07.03. 08.06.	0.000 0.000	N
8.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung												

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
3.94 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.06.2016	09.06.2020	26 672 141	%	99.580	100.000	100.000	07.03. 08.06. 07.09. 07.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Protection Participation auf Zurich Insur Grp N	USD	1'000.00	22.06.2016	22.06.2020	26 672 219	%	100.230	95.980	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	30.06.2017	30.06.2020	34 412 013	%	95.090	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	30.06.2017	30.06.2020	34 412 015	%	95.280	100.000	100.000		0.000	Y
Magnet Certificate auf Aktien	CHF	1'000.00	11.07.2014	10.07.2020	24 206 623	%	103.220	95.910	100.000	10.07.	10.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	13.07.2017	13.07.2020	34 412 043	%	99.590	100.000	100.000		0.000	Y
4.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.07.2016	14.07.2020	32 581 129	%	100.150	100.000	100.000	14.07.	0.000	N
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	17.07.2017	17.07.2020	34 412 056	%	100.830	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	20.07.2017	20.07.2020	34 412 062	%	101.850	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	24.07.2017	24.07.2020	34 412 409	%	98.710	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 2.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.01.2017	30.07.2020	34 411 691		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	01.08.2017	03.08.2020	34 412 416	%	98.350	95.120	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	03.08.2017	03.08.2020	34 412 438	%	98.640	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	10.08.2017	10.08.2020	37 155 334	%	98.550	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	10.08.2017	10.08.2020	37 155 336	%	94.730	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	31.08.2017	31.08.2020	37 155 380	%	97.590	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Fonds 15.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.323%	USD	1'000.00	18.09.2014	18.09.2020	24 206 685		-	88.170	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Basket	CHF	1'000.00	11.09.2015	11.10.2020	26 671 630	%	108.750	86.350	101.500		0.000	Y
Structured Note	GBP	1'000.00	04.09.2015	12.10.2020	26 671 632	%	103.360	100.000	100.000	12.01. 12.04. 12.07. 11.10.	9.702 9.687 9.682 9.994	N
4 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	19.10.2016	19.10.2020	32 951 247	%	99.160	100.000	100.000	12.01. 14.02. 14.03. 13.04. 12.05. 14.06. 13.07. 14.08. 14.09. 13.10. 13.11. 13.12.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
3.4 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	03.11.2017	03.11.2020	38 649 033	%	96.640	100.000	100.000		0.000	N
Worst of Express Certificate auf Indizes 15.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.494%	CAD	100.00	17.06.2014	17.12.2020	24 206 631		-	86.980	100.000		0.000	Y
Structured Note auf 3.65 Western 18SrN	CHF	1'000.00	05.11.2014	04.01.2021	25 141 619	%	102.450	99.300	100.000	22.12.	9.972	N
Structured Note auf Aktie	CHF	1'000.00	23.12.2014	04.01.2021	25 141 822	%	35.000	90.110	100.000	04.01.	10.000	Y
Structured Note auf 5.8 Barrick 34 Nts	CHF	1'000.00	09.02.2015	04.01.2021	26 280 818	%	85.990	100.000	100.000	04.01. 04.04. 04.07. 07.10.	3.066 3.000 2.426 3.166	N
2.1 % Structured Note on 5.8 Barrick 34 Nts	CHF	1'000.00	19.02.2016	08.01.2021	30 463 219	%	105.210	100.000	100.000	09.01. 10.04. 10.07. 08.10.	5.191 5.308 5.250 5.250	N
Protection Participation auf SMI	AUD	1'000.00	17.01.2017	19.01.2021	34 411 563	%	103.750	90.970	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	02.02.2015	02.02.2021	26 280 819	%	101.150	95.000	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 8.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	15.03.2017	15.03.2021	33 874 425		-	100.000	100.000		0.000	Y
Structured Note on Reference Bond (Dexia)	CHF	1'000.00	19.02.2015	06.04.2021	26 670 972	%	100.480	94.280	100.000	28.03.	10.000	N
(1.1 % min.) Structured Note with reference bond	CHF	1'000.00	07.05.2015	09.04.2021	26 671 164	%	83.410	100.000	100.000	09.01. 10.04. 10.07. 09.10.	2.780 2.780 2.085 2.780	N
Protection Participation auf SMI	USD	1'000.00	18.04.2017	19.04.2021	34 412 110	%	101.310	92.670	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	20.10.2017	20.04.2021	38 089 720	%	95.160	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	12.05.2017	12.05.2021	34 412 254	%	99.060	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	14.12.2017	14.06.2021	38 649 221	%	96.750	100.000	100.000		0.000	Y
Structured Note auf Referenz anleihe	EUR	1'000.00	22.04.2015	12.07.2021	26 671 225	%	99.490	100.000	100.000	12.01. 12.04. 12.07. 12.10.	3.842 3.735 3.896 4.137	N
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	17.08.2015	11.10.2021	26 671 553	%	100.670	99.390	100.000		0.000	Y
Structured Note on Glencore	CHF	1'000.00	04.09.2015	11.10.2021	26 671 590	%	103.060	100.000	100.000	11.01. 11.04. 11.07. 11.10.	5.111 5.000 5.055 5.111	N
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	05.11.2015	05.11.2021	26 671 844	%	97.860	94.000	94.000		0.000	Y
1.2 % Protection Participation auf Aktien	AUD	1'000.00	16.11.2015	16.11.2021	26 671 871	%	101.970	92.640	100.000	16.11.	9.050	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	17.11.2017	17.11.2021	38 649 078	%	98.690	90.000	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 21.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	23.12.2016	23.12.2021	33 874 167		-	100.000	100.000		0.000	Y
Structured Note mit Kreditrisiko auf RWE AG var.	CHF	1'000.00	23.10.2015	10.01.2022	26 671 817	%	102.620	100.000	100.000	23.03. 23.06. 24.09. 27.12.	2.250 2.300 2.300 2.350	N
2 % Structured Note mit Kreditrisiko auf LAFARGEHOLCIM LTD	EUR	1'000.00	11.03.2016	10.01.2022	30 463 347	%	104.560	100.000	100.000	10.01. 10.04. 10.07. 11.10.	5.368 5.342 5.505 5.823	N
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.03.2017	07.03.2022	34 411 846	%	99.780	100.000	100.000		0.000	Y
Structured Note	CHF	1'000.00	06.03.2015	11.04.2022	26 671 014	%	104.640	95.020	100.000	27.03.	4.970	Y
Protection Participation auf SMI	CHF	1'000.00	22.02.2017	22.08.2022	34 411 737	%	100.750	90.000	90.000		0.000	Y
Structured Note auf Aktien	CHF	1'000.00	24.08.2017	24.08.2022	37 155 585	%	97.930	90.000	90.000		0.000	Y
Protection Participation auf Basket	CHF	1'000.00	13.10.2015	11.10.2022	26 671 757	%	101.970	91.610	100.000		0.000	Y
Structured Note auf Aktien mit Kreditrisiko	CHF	1'000.00	13.10.2015	11.10.2022	26 671 758	%	98.910	95.807	100.000	23.09.	5.000	Y
1.7 % Structured Note auf LafargeHolcim	EUR	1'000.00	30.10.2015	10.01.2023	26 671 847	%	101.670	100.000	100.000	23.03. 23.06. 25.09. 27.12.	4.549 4.713 5.105 5.161	N
1.1 % Structured Note auf LafargeHolcim	CHF	1'000.00	30.10.2015	10.01.2023	26 671 841	%	100.720	100.000	100.000	23.03. 23.06. 24.09. 24.12.	2.750 2.811 2.841 2.780	N
1 % Structured Note mit Kreditrisiko auf LafargeHolcim	CHF	1'000.00	25.11.2015	10.01.2023	26 671 915	%	99.590	100.000	100.000	23.03. 23.06. 24.09. 24.12.	2.500 2.555 2.583 2.527	N
Protection Participation auf SMI	CHF	1'000.00	03.02.2017	03.02.2023	34 411 609	%	101.530	90.000	90.000		0.000	Y
Protection Participation auf SMI	CHF	1'000.00	03.03.2017	03.03.2023	34 411 754	%	100.940	90.000	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 21.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	09.03.2017	21.03.2023	33 874 404		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	26.05.2017	26.05.2023	34 411 920	%	99.140	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	30.05.2017	30.05.2023	34 412 235	%	96.800	94.000	94.000		0.000	Y
Protection Participation 2016-04.07.23 auf Aktien	CHF	1'000.00	27.07.2016	11.07.2023	32 581 205	%	98.120	93.960	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	EUR	1'000.00	27.07.2016	11.07.2023	32 581 206	%	95.600	93.830	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	CHF	1'000.00	04.10.2017	04.10.2023	38 089 631	%	103.830	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf SMI	CHF	1'000.00	06.10.2017	06.10.2023	38 089 479	%	99.260	90.000	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.10.2017	11.10.2023	37 155 502	%	98.530	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf SMI	CHF	1'000.00	03.11.2017	03.11.2023	38 089 676	%	99.010	90.000	90.000		0.000	Y
Protection Participation auf SMI	CHF	1'000.00	05.05.2017	06.11.2023	34 412 113	%	97.420	92.000	92.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.11.2017	21.11.2023	38 089 540	%	101.070	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.12.2017	06.12.2023	38 089 593	%	96.970	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	06.12.2017	06.12.2023	38 649 202	%	98.360	100.000	100.000		0.000	Y
Capital Protection auf Basket 27.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 80.00%	CHF	1'000.00	27.12.2013	27.12.2023	20 712 102		-	68.390	80.000		0.000	Y
Capital Protection auf Basket 27.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.00%	CHF	1'000.00	27.12.2013	27.12.2023	20 712 103		-	76.940	90.000		0.000	Y
Capital Protection auf Basket 27.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	27.12.2013	27.12.2023	20 712 104		-	85.490	100.000		0.000	Y
Capital Protection on Basket	CHF	1'000.00	27.12.2013	27.12.2023	20 712 105	%	62.770	82.930	97.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2017		IUP
								Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	
Capital Protection Certificate on Equities	CHF	1'000.00	10.04.2014	15.04.2024	22 829 373	%	109.090	94.910	108.000		0.000	Y
Capital Protection auf Aktien	CHF	1'000.00	11.07.2014	08.07.2024	22 829 535	%	71.030	87.730	97.000		0.000	Y
Structured Note auf Aktien	CHF	1'000.00	19.05.2017	11.07.2024	34 412 225	%	97.250	93.815	100.000		0.000	Y
Structured Note auf Basket	CHF	1'000.00	27.06.2017	11.07.2024	34 412 312	%	98.000	95.710	100.000		0.000	Y
Structured Note auf Basket	CHF	1'000.00	29.09.2017	11.07.2024	37 155 616	%	98.850	97.020	100.000		0.000	Y
Kapitalschutz-Zertifikat auf Basket	CHF	1'000.00	23.09.2014	23.09.2024	24 206 868	%	105.070		100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.01.2015	31.12.2024	25 141 432	%	75.440	90.380	95.000		0.000	Y
Autocallable Capital Protection with Coupon auf Aktien	CHF	1'000.00	05.01.2015	31.12.2024	25 141 434	%	100.900	85.630	90.000		0.000	Y
3.4 % Reverse Convertible auf CHF 15Y Swap	CHF	1'000.00	23.03.2015	21.03.2025	26 280 847	%	82.640	100.000	100.000	15.03. 15.06. 15.09. 15.12.	0.44513 0.44513 0.44513 0.44513	N
0.6 % Protection Participation auf Basket	CHF	1'000.00	07.04.2015	10.04.2025	26 671 133	%	102.680	97.610	100.000	24.03.	5.983	N
Structured Note auf Aktien	CHF	1'000.00	06.05.2016	06.05.2026	31 452 063	%	88.890	90.000	90.000		0.000	Y
Structured Note 2016-20.05.26 auf Aktien	CHF	1'000.00	26.05.2016	26.05.2026	31 452 184	%	87.830	90.000	90.000		0.000	Y
3.2 % Reverse Convertible auf CHF 10Y Swap	CHF	1'000.00	19.12.2014	18.12.2026	25 141 802	%	90.310	100.000	100.000	15.03. 15.06. 16.09. 16.12.	1.725 1.763 1.763 1.744	N
Protection Participation auf Aktien	CHF	1'000.00	05.01.2015	30.12.2026	25 141 424	%	105.150	99.930	108.000		0.000	Y
Capital Protection auf Basket	CHF	1'000.00	27.12.2013	27.12.2028	20 712 106	%	81.960	75.660	100.050		0.000	Y
Capital Protection auf Basket	CHF	1'000.00	27.12.2013	27.12.2028	20 712 137	%	111.580	75.630	100.000		0.000	Y
Capital Protection on Equities	CHF	1'000.00	09.04.2014	09.04.2029	22 829 298	%	88.620	78.230	100.000		0.000	Y
Capital Protection on Equities	CHF	1'000.00	09.04.2014	09.04.2029	22 829 297	%	108.090	78.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	09.06.2017	22.06.2029	34 411 734	%	89.730	96.690	100.000		0.000	Y
Capital Protection auf Aktien	CHF	1'000.00	11.07.2014	09.07.2029	22 829 537	%	107.040	80.580	100.000		0.000	Y
Capital Protection auf Aktien	CHF	1'000.00	11.07.2014	09.07.2029	22 829 536	%	85.380	80.632	100.000		0.000	Y
3 % p.a. Reverse Convertible on CHF 30Y Swap	CHF	1'000.00	12.11.2014	21.09.2029	25 141 465	%	88.990	100.000	100.000	15.03. 15.06. 15.09. 15.12.	7.500 7.666 7.666 7.583	N
Capital Protected with Conditional Coupon auf Aktien	CHF	1'000.00	05.01.2015	31.12.2029	25 141 430	%	101.270	85.450	96.000		0.000	Y
Capital Protected with Conditional Coupon auf Aktien	CHF	1'000.00	05.01.2015	31.12.2029	25 141 431	%	86.560	84.570	95.010		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2017		IUP
								Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	
UBS AG, Zürich und Basel, Schweiz												
Underlying Tracker auf SMI	CHF	1'000.00	26.05.2017	26.05.2021	35 519 905	CHF	997.500	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf SMI Mid P	CHF	1'000.00	26.05.2017	26.05.2021	35 519 907	CHF	1071.430	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf SLI Swiss Leader Pr	CHF	1'000.00	26.05.2017	26.05.2021	35 519 906	CHF	1020.220	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Zuercher Kantonalbank, Zuerich, Schweiz												
8 % (15.6522 % p.a.) Reverse Convertible auf Meyer Burger N	CHF	1'000.00	30.06.2016	04.01.2017	30 507 564		-	100.000	100.000	04.01.	0.000	Y
6.48 % Reverse Convertible 2015-05.01.17 auf Aktien	CHF	1'000.00	05.01.2016	05.01.2017	25 347 311		-	100.000	100.000	05.01.	0.000	Y
5.79 % Reverse Convertible 2015-05.01.17 auf Aktien	CHF	1'000.00	05.01.2016	05.01.2017	25 347 314		-	100.000	100.000	05.01.	0.000	Y
6.63 % (6.4683 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.12.2015	09.01.2017	25 347 302		-	100.000	100.000	09.01.	0.000	Y
9.57 % (9.4909 % p.a.) Reverse Convertible 2015-09.01.17 auf Aktien	CHF	1'000.00	06.01.2016	09.01.2017	25 347 317		-	100.000	100.000	09.01.	0.000	Y
4.94 % (9.613 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.07.2016	09.01.2017	30 507 593		-	100.000	100.000	09.01.	0.000	Y
7.02 % (7.0006 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.01.2016	13.01.2017	25 347 333		-	100.000	100.000	13.01.	0.000	Y
7.99 % (8.0123 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.01.2016	13.01.2017	25 347 346		-	100.000	100.000	13.01.	0.000	Y
7 % (7.0391 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	15.01.2016	13.01.2017	25 347 354		-	100.000	100.000	13.01.	0.000	Y
7.77 % (7.7485 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.01.2016	16.01.2017	25 347 351		-	100.000	100.000	16.01.	0.000	Y
5.27 % (5.2264 % p.a.) Reverse Convertible auf Indizes	USD	1'000.00	14.01.2016	17.01.2017	25 347 345		-	100.000	100.000	17.01.	5.783	N
8.78 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.01.2016	19.01.2017	25 347 369		-	100.000	100.000	19.01.	0.000	Y
6.68 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.01.2016	20.01.2017	25 347 389		-	100.000	100.000	20.01.	0.000	Y
6.74 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.01.2016	20.01.2017	25 347 390		-	100.000	100.000	20.01.	0.000	Y
9.63 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.01.2016	20.01.2017	25 347 392		-	100.000	100.000	20.01.	0.000	Y
6.67 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.01.2016	20.01.2017	25 347 388		-	100.000	100.000	20.01.	0.000	Y
6.97 % (6.9894 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.01.2016	20.01.2017	25 347 397		-	100.000	100.000	20.01.	0.000	Y
7.1 % (7.1198 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.01.2016	20.01.2017	30 506 608		-	100.000	100.000	20.01.	0.000	Y
7.06 % (7.0797 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.01.2016	20.01.2017	30 506 610		-	100.000	100.000	20.01.	0.000	Y
10.23 % (10.2585 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.01.2016	20.01.2017	30 506 611		-	100.000	100.000	20.01.	0.000	Y
7.65 % (7.6927 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.01.2016	20.01.2017	30 506 615		-	100.000	100.000	20.01.	0.000	Y
7.32 % (7.3609 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.01.2016	20.01.2017	30 506 613		-	100.000	100.000	20.01.	0.000	Y
5.52 % (5.4895 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.01.2016	23.01.2017	30 506 612		-	100.000	100.000	23.01.	0.000	Y
6.13 % (6.0961 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.01.2016	23.01.2017	30 506 609		-	100.000	100.000	23.01.	0.000	Y
7.22 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.01.2016	25.01.2017	30 506 617		-	100.000	100.000	25.01.	0.000	Y
6.9 % (6.9192 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.01.2016	25.01.2017	30 506 629		-	100.000	100.000	25.01.	0.000	Y
5.65 % (5.1756 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.12.2015	27.01.2017	25 347 287		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
6.63 % (6.0733 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.12.2015	27.01.2017	25 347 291		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
3.86 % (3.5722 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.12.2015	27.01.2017	25 347 292		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
3.65 % (3.3953 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.12.2015	27.01.2017	25 347 310		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
6.42 % (6.1468 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.01.2016	27.01.2017	25 347 325		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
5.33 % (5.1032 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.01.2016	27.01.2017	25 347 322		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
5.39 % (5.1606 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.01.2016	27.01.2017	25 347 324		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
7.31 % (6.9989 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.01.2016	27.01.2017	25 347 323		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
8.84 % (8.4864 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.01.2016	27.01.2017	25 347 334		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
8.86 % (8.5056 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.01.2016	27.01.2017	25 347 335		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
5.39 % (5.1744 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.01.2016	27.01.2017	25 347 326		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
5 1/4 % (5.04 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.01.2016	27.01.2017	25 347 329		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4.35 % (4.176 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.01.2016	27.01.2017	25 347 332		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
3.72 % (3.5807 % p.a.) Reverse Convertible auf Sonova Hldg N	CHF	1'000.00	13.01.2016	27.01.2017	25 347 338		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
6.23 % (5.9968 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	13.01.2016	27.01.2017	25 347 340		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
5.61 % (5.4 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.01.2016	27.01.2017	25 347 339		-	100.000	100.000		0.000	Y
9.15 % (8.8311 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.01.2016	27.01.2017	25 347 343		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
8.74 % (8.4581 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.01.2016	27.01.2017	25 347 355		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
12.33 % (11.9323 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.01.2016	27.01.2017	25 347 356		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
5.48 % (5.3463 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.01.2016	27.01.2017	25 347 359		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
7.33 % (7.1512 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.01.2016	27.01.2017	25 347 364		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
5.59 % (5.4537 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.01.2016	27.01.2017	25 347 362		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
7.17 % (7.0141 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.01.2016	27.01.2017	25 347 376		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
3.83 % (3.7467 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.01.2016	27.01.2017	25 347 378		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
6.64 % (6.4957 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.01.2016	27.01.2017	25 347 374		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
8.08 % (7.9043 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.01.2016	27.01.2017	25 347 375		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
11.16 % (10.9471 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.01.2016	27.01.2017	25 347 382		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
9.11 % (8.9362 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.01.2016	27.01.2017	25 347 381		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
7.02 % (6.9049 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.01.2016	27.01.2017	25 347 395		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
8.68 % (8.5377 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.01.2016	27.01.2017	30 506 607		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
8.68 % (8.5377 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.01.2016	27.01.2017	30 506 606		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
7.14 % (7.023 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.01.2016	27.01.2017	30 506 605		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
5.76 % (5.6656 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	21.01.2016	27.01.2017	25 347 398		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
7.06 % (6.9443 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.01.2016	27.01.2017	25 347 394		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
5.11 % (5.0262 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	21.01.2016	27.01.2017	25 347 396		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
8.15 % (8.105 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.01.2016	27.01.2017	30 506 622		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
13.88 % (13.8033 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.01.2016	27.01.2017	30 506 621		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
4.48 % (4.4552 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	10'000.00	25.01.2016	27.01.2017	30 506 620		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
5 1/2 % (5.4848 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.01.2016	27.01.2017	30 506 625		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
7.24 % (7.2199 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.01.2016	27.01.2017	30 506 624		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
7.55 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.01.2016	27.01.2017	30 506 632		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
7 1/2 % (7.5209 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.01.2016	27.01.2017	30 506 654		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
3 1/4 % (3.8614 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.03.2016	27.01.2017	30 506 942		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
3 1/4 % (3.8614 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	24.03.2016	27.01.2017	30 506 941		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
6.05 % (7.6154 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.04.2016	27.01.2017	30 507 004		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
2.82 % (4.2835 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.05.2016	27.01.2017	30 507 352		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
3.35 % (5.1102 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.06.2016	27.01.2017	30 507 364		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
3.15 % (4.8255 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	02.06.2016	27.01.2017	30 507 365		-	100.000	100.000	27.01.	2.730	N
4.33 % (7.4229 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.06.2016	27.01.2017	30 507 542		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.63 % (9.6976 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.06.2016	27.01.2017	30 507 552		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
3.15 % (5.4258 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.06.2016	27.01.2017	30 507 555		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
3 % (5.1675 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.06.2016	27.01.2017	30 507 549		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
3.86 % (6.7456 % p.a.) Reverse Convertible auf Siemens N	EUR	1'000.00	01.07.2016	27.01.2017	30 507 575		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	N
4.28 % (7.4796 % p.a.) Reverse Convertible auf Julius Baer GrpN	CHF	1'000.00	01.07.2016	27.01.2017	30 507 573		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
1.8 % (3.1456 % p.a.) Reverse Convertible auf SMI	CHF	1'000.00	01.07.2016	27.01.2017	30 507 578		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
1 3/4 % (3.1188 % p.a.) Reverse Convertible auf ABB N	CHF	1'000.00	05.07.2016	27.01.2017	32 771 123		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
3.69 % (6.8123 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.07.2016	27.01.2017	32 771 173		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
6.97 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.02.2016	03.02.2017	30 506 680		-	100.000	100.000	03.02.	0.000	Y
3.65 % (6.2871 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.07.2016	03.02.2017	30 507 600		-	100.000	100.000	03.02.	0.000	Y
3.04 % (5.2364 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.07.2016	03.02.2017	30 507 599		-	100.000	100.000	03.02.	0.000	Y
7.79 % (6.9761 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.12.2015	06.02.2017	25 347 288		-	100.000	100.000	06.02.	0.000	Y
5.16 % (5.1315 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.02.2016	06.02.2017	30 506 696		-	100.000	100.000	06.02.	0.000	Y
5 1/4 % (5.221 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.02.2016	06.02.2017	30 506 694		-	100.000	100.000	06.02.	0.000	Y
10.41 % (11.1205 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.02.2016	07.02.2017	30 506 834		-	100.000	100.000	07.02.	0.000	Y
6.83 % (6.849 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.02.2016	09.02.2017	30 506 741		-	100.000	100.000	09.02.	0.000	Y
12.26 % (12.2942 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.02.2016	10.02.2017	30 506 747		-	100.000	100.000	10.02.	0.000	Y
12.54 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.02.2016	16.02.2017	30 506 766		-	100.000	100.000	16.02.	0.000	Y
5.62 % (5.589 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.02.2016	17.02.2017	30 506 758		-	100.000	100.000	17.02.	0.000	Y
9.31 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.02.2016	17.02.2017	30 506 774		-	100.000	100.000	17.02.	0.000	Y
16.3 % (16.3454 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.02.2016	17.02.2017	30 506 779		-	100.000	100.000	17.02.	0.000	Y
4.15 % (4.0488 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	11.02.2016	20.02.2017	30 506 749		-	100.000	100.000	20.02.	0.00665	N
3.15 % (6.1967 % p.a.) Reverse Convertible auf Novartis N	CHF	1'000.00	19.08.2016	22.02.2017	32 771 401		-	100.000	100.000	22.02.	0.000	Y
8.44 % (7.8715 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.01.2016	24.02.2017	30 506 652		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
8.88 % (8.2819 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.01.2016	24.02.2017	30 506 653		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
11.67 % (10.8839 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.01.2016	24.02.2017	30 506 646		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
4.93 % (4.5979 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.01.2016	24.02.2017	30 506 645		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
7.84 % (7.3885 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.02.2016	24.02.2017	30 506 677		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
6.89 % (6.4932 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.02.2016	24.02.2017	30 506 676		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
6.7 % (6.3307 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.02.2016	24.02.2017	30 506 684		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
8.51 % (8.0409 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.02.2016	24.02.2017	30 506 686		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
3.92 % (3.7137 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.02.2016	24.02.2017	30 506 688		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
7.07 % (6.6979 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.02.2016	24.02.2017	30 506 700		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
9.7 % (9.1895 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.02.2016	24.02.2017	30 506 699		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
10.86 % (10.2884 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.02.2016	24.02.2017	30 506 695		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
9.92 % (9.3979 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.02.2016	24.02.2017	30 506 689		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
11.35 % (10.781 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.02.2016	24.02.2017	30 506 708		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
14.18 % (13.4691 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.02.2016	24.02.2017	30 506 711		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.79 % (5.4997 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.02.2016	24.02.2017	30 506 722		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
10.78 % (10.2396 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.02.2016	24.02.2017	30 506 721		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
8.47 % (8.0454 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.02.2016	24.02.2017	30 506 719		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
7.46 % (7.1426 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.02.2016	24.02.2017	30 506 727		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
8.61 % (8.2877 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	10.02.2016	24.02.2017	30 506 743		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
8 3/4 % (8.4225 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	10.02.2016	24.02.2017	30 506 744		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
7.49 % (7.229 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.02.2016	24.02.2017	30 506 748		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
4.76 % (4.6065 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.02.2016	24.02.2017	30 506 752		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
17 1/2 % (17.1196 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.02.2016	24.02.2017	30 506 767		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
9.71 % (9.4989 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.02.2016	24.02.2017	30 506 768		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
9.99 % (9.7728 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.02.2016	24.02.2017	30 506 762		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
9.81 % (9.5967 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.02.2016	24.02.2017	30 506 765		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
12.56 % (12.4906 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.02.2016	24.02.2017	30 506 782		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
9.44 % (9.4139 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.02.2016	24.02.2017	30 506 786		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
8.15 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.02.2016	24.02.2017	30 506 792		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
8.17 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.02.2016	24.02.2017	30 506 810		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
9.51 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.02.2016	24.02.2017	30 506 798		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
4.61 % (8.2567 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.08.2016	24.02.2017	32 771 304		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
3.35 % (6.663 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.08.2016	01.03.2017	32 771 449		-	100.000	100.000	01.03.	0.000	Y
4.58 % (4.5421 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.03.2016	06.03.2017	30 506 853		-	100.000	100.000	06.03.	0.000	Y
11.15 % (11.0884 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.03.2016	06.03.2017	30 514 048		-	100.000	100.000	06.03.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.03.2016	15.03.2017	30 506 902		-	100.000	100.000	15.03.	0.000	Y
Underlying Tracker auf LafargeHolcim N	CHF	41.29	17.03.2016	17.03.2017	30 506 858		-	100.000	100.000		0.000	N
8 3/4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.03.2016	21.03.2017	30 506 928		-	100.000	100.000	21.03.	0.000	Y
5.97 % (5.9866 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.03.2016	22.03.2017	30 506 937		-	100.000	100.000	22.03.	0.000	Y
3.15 % (3.9103 % p.a.) Reverse Convertible auf Geberit N	CHF	1'000.00	02.06.2016	22.03.2017	30 507 370		-	100.000	100.000	22.03.	0.000	Y
6.69 % (6.7086 % p.a.) Reverse Convertible auf Galenica N	CHF	5'000.00	24.03.2016	23.03.2017	30 506 946		-	100.000	100.000	23.03.	0.000	Y
4.17 % (3.8591 % p.a.) Reverse Convertible auf Swisscom N	CHF	1'000.00	25.02.2016	24.03.2017	30 506 818		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
11 3/4 % (10.874 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.02.2016	24.03.2017	30 506 819		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
13.79 % (12.762 % p.a.) Reverse Convertible auf CS Group N	CHF	1'000.00	25.02.2016	24.03.2017	30 506 816		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
4.93 % (4.5625 % p.a.) Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	25.02.2016	24.03.2017	30 506 817		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
12.26 % (11.346 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.02.2016	24.03.2017	30 506 811		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
6.27 % (5.8026 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.02.2016	24.03.2017	30 506 821		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
6.04 % (5.6041 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.02.2016	24.03.2017	30 506 826		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
7.38 % (6.9188 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.02.2016	24.03.2017	30 506 839		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
11.32 % (10.6681 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.03.2016	24.03.2017	30 506 847		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
10.36 % (9.7634 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.03.2016	24.03.2017	30 506 849		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
15.26 % (14.3812 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.03.2016	24.03.2017	30 506 850		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
8.07 % (7.6052 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.03.2016	24.03.2017	30 506 848		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.27 % (5.0324 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	07.03.2016	24.03.2017	30 506 859		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
13.69 % (13.2129 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.03.2016	24.03.2017	30 506 885		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
10.49 % (10.1244 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.03.2016	24.03.2017	30 506 891		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
7.3 % (7.0456 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.03.2016	24.03.2017	30 506 886		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
4.85 % (4.7446 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.03.2016	24.03.2017	30 506 908		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
9.48 % (9.2739 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.03.2016	24.03.2017	30 506 906		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
11.92 % (11.6926 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.03.2016	24.03.2017	30 506 910		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
8.32 % (8.1613 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.03.2016	24.03.2017	30 506 915		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
4.88 % (4.7869 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.03.2016	24.03.2017	30 506 914		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
9.05 % (8.9752 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.03.2016	24.03.2017	30 506 926		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
6.72 % (6.6645 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.03.2016	24.03.2017	30 506 925		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
6.63 % (6.5752 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.03.2016	24.03.2017	30 506 923		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
5.74 % (5.6926 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.03.2016	24.03.2017	30 506 924		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
6.78 % (6.7425 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.03.2016	24.03.2017	30 506 935		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
8.67 % (8.6221 % p.a.) Reverse Convertible auf Aryzta N 3.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	22.03.2016	24.03.2017	30 506 936		-	100.000	100.000		0.000	Y
6.09 % (6.0564 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.03.2016	24.03.2017	30 506 932		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
5.59 % (5.5745 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.03.2016	24.03.2017	30 506 938		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
7.27 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.03.2016	24.03.2017	30 506 943		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
2.31 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.03.2016	24.03.2017	30 506 944		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
7.33 % (7.4754 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.04.2016	24.03.2017	30 506 970		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
4.58 % (5.4059 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.05.2016	24.03.2017	30 507 276		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
7.45 % (9.1224 % p.a.) Reverse Convertible auf ams	CHF	1'000.00	30.05.2016	24.03.2017	30 507 344		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
4.36 % (5.5074 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.06.2016	24.03.2017	30 507 437		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
4.36 % (5.5074 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.06.2016	24.03.2017	30 507 439		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
5.62 % (9.6804 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.08.2016	24.03.2017	32 771 425		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
2.71 % (4.759 % p.a.) Reverse Convertible auf Bayer N	CHF	1'000.00	29.08.2016	24.03.2017	32 771 442		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
3.59 % (6.4945 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	05.09.2016	24.03.2017	32 771 494		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
3.69 % (6.9916 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.09.2016	24.03.2017	32 771 558		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
2 3/4 % (5.4396 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.09.2016	24.03.2017	32 771 633		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
3.37 % (3.3888 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.03.2016	27.03.2017	30 506 948		-	100.000	100.000	27.03.	0.000	Y
9.15 % (9.1755 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.04.2016	30.03.2017	30 506 972		-	100.000	100.000	30.03.	0.000	Y
4.22 % (4.5349 % p.a.) Reverse Convertible auf Swisscom N	CHF	1'000.00	25.04.2016	31.03.2017	30 507 058		-	100.000	100.000	31.03.	0.000	Y
8.51 % (6.7929 % p.a.) Reverse Convertible 2015-06.04.17 auf Aktien	CHF	1'000.00	05.01.2016	06.04.2017	25 347 315		-	100.000	100.000	06.04.	0.000	Y
9.65 % (8.2518 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.02.2016	06.04.2017	30 506 714		-	100.000	100.000	06.04.	0.000	Y
9.33 % (7.9781 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.02.2016	06.04.2017	30 506 709		-	100.000	100.000	06.04.	0.000	Y
10.76 % (9.201 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.02.2016	06.04.2017	30 506 705		-	100.000	100.000	06.04.	0.000	Y
8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.04.2016	07.04.2017	30 506 991		-	100.000	100.000	07.04.	0.000	Y
5.33 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.04.2016	07.04.2017	30 506 986		-	100.000	100.000	07.04.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.33 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.04.2016	07.04.2017	30 506 987		-	100.000	100.000	07.04.	0.000	Y
2.39 % (3.7737 % p.a.) Reverse Convertible auf Nestle N	CHF	1'000.00	19.08.2016	07.04.2017	32 771 400		-	100.000	100.000	07.04.	0.000	Y
2.82 % (5.2062 % p.a.) Reverse Convertible auf Nestle N	CHF	1'000.00	22.09.2016	07.04.2017	32 771 614		-	100.000	100.000	07.04.	0.000	Y
2.88 % (5.7282 % p.a.) Reverse Convertible auf Swisscom N	CHF	1'000.00	06.10.2016	07.04.2017	32 771 728		-	100.000	100.000	07.04.	0.000	Y
2.23 % (4.4354 % p.a.) Reverse Convertible auf Nestle N	CHF	1'000.00	06.10.2016	07.04.2017	32 771 729		-	100.000	100.000	07.04.	0.000	Y
15.95 % (14.648 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	08.03.2016	10.04.2017	30 506 869		-	100.000	100.000	10.04.	0.000	Y
4.47 % (5.549 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.06.2016	10.04.2017	30 507 495		-	100.000	100.000	10.04.	0.000	Y
2.45 % (3.0414 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.06.2016	10.04.2017	30 507 494		-	100.000	100.000	10.04.	0.000	Y
6.55 % Reverse Convertible auf LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	13.04.2016	13.04.2017	30 507 018		-	100.000	100.000	13.04.	0.000	Y
4.96 % (4.919 % p.a.) Reverse Convertible auf Galenica N	CHF	1'000.00	21.04.2016	24.04.2017	30 507 046		-	100.000	100.000	24.04.	0.000	Y
4.66 % (4.6215 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.04.2016	25.04.2017	30 507 051		-	100.000	100.000	25.04.	0.000	Y
4.22 % (7.6342 % p.a.) Reverse Convertible auf Adecco Group N	CHF	1'000.00	06.10.2016	25.04.2017	32 771 730		-	100.000	100.000	25.04.	0.000	Y
4.51 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.04.2016	26.04.2017	30 507 066		-	100.000	100.000	26.04.	0.000	Y
6.81 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.04.2016	27.04.2017	30 507 075		-	100.000	100.000	27.04.	0.000	Y
5.08 % (4.7013 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	29.03.2016	28.04.2017	30 506 950		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
10.33 % (9.5599 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.03.2016	28.04.2017	30 506 952		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
5.11 % (4.729 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.03.2016	28.04.2017	30 506 951		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
4.99 % (4.618 % p.a.) Reverse Convertible auf Galenica N	CHF	5'000.00	29.03.2016	28.04.2017	30 506 957		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
7.91 % (7.3203 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.03.2016	28.04.2017	30 506 958		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
7.09 % (6.5784 % p.a.) Reverse Convertible auf Galenica N	CHF	1'000.00	30.03.2016	28.04.2017	30 506 963		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
8.99 % (8.4281 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.04.2016	28.04.2017	30 506 974		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
4.96 % (4.65 % p.a.) Reverse Convertible auf Galenica N	CHF	1'000.00	04.04.2016	28.04.2017	30 506 975		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
6.21 % (5.8371 % p.a.) Reverse Convertible auf Galenica N	CHF	5'000.00	05.04.2016	28.04.2017	30 506 978		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
6.94 % (6.5403 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.04.2016	28.04.2017	30 506 985		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
5.81 % (5.4754 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	100'000.00	06.04.2016	28.04.2017	30 506 980		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
4.57 % (4.3068 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	06.04.2016	28.04.2017	30 506 981		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
5.24 % (4.9512 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.04.2016	28.04.2017	30 506 988		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
6.78 % (6.4063 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.04.2016	28.04.2017	30 506 990		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
6.53 % (6.1863 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	08.04.2016	28.04.2017	30 506 992		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
7.24 % (6.8589 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.04.2016	28.04.2017	30 506 997		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
6.58 % (6.2337 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	08.04.2016	28.04.2017	30 506 993		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
4.67 % (4.4713 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.04.2016	28.04.2017	30 507 008		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
4.68 % (4.4809 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	12.04.2016	28.04.2017	30 507 007		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
9.74 % (9.3255 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.04.2016	28.04.2017	30 507 010		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
2.7 % (2.5851 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.04.2016	28.04.2017	30 507 006		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
5.73 % (5.5008 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	13.04.2016	28.04.2017	30 507 013		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
6.01 % (5.7696 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	13.04.2016	28.04.2017	30 507 012		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
11.16 % (10.771 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.04.2016	28.04.2017	30 507 025		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
11.12 % (10.7324 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.04.2016	28.04.2017	30 507 030		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
4.85 % (4.681 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.04.2016	28.04.2017	30 507 023		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
7.72 % (7.5114 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.04.2016	28.04.2017	30 507 031		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
7 1/4 % (7.0541 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.04.2016	28.04.2017	30 507 035		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
5.82 % (5.6627 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	20'000.00	18.04.2016	28.04.2017	30 507 034		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
8.35 % (8.1463 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.04.2016	28.04.2017	30 507 036		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
3.71 % (3.6392 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.04.2016	28.04.2017	30 507 042		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
6.59 % (6.4643 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	21.04.2016	28.04.2017	30 507 041		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
9.12 % (8.946 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.04.2016	28.04.2017	30 507 048		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
12.57 % (12.3302 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.04.2016	28.04.2017	30 507 047		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
6.68 % (6.5526 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.04.2016	28.04.2017	30 507 040		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
6.57 % (6.4623 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.04.2016	28.04.2017	30 507 054		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
13.61 % (13.3869 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.04.2016	28.04.2017	30 507 052		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
5.4 % (5.3115 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.04.2016	28.04.2017	30 507 055		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
5.77 % (5.7223 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	10'000.00	25.04.2016	28.04.2017	30 507 062		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
5.78 % (5.7481 % p.a.) Reverse Convertible auf Dufry N	CHF	1'000.00	26.04.2016	28.04.2017	30 507 068		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
9.16 % (9.1094 % p.a.) Reverse Convertible auf Basilea Pharmaceu N	CHF	1'000.00	26.04.2016	28.04.2017	30 507 067		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
6.61 % (6.5917 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.04.2016	28.04.2017	30 507 073		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
10.93 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.04.2016	28.04.2017	30 507 080		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
11 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	28.04.2016	28.04.2017	30 507 079		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
11.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.04.2016	28.04.2017	30 507 078		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
10.24 % Reverse Convertible auf Leonteq N	CHF	1'000.00	28.04.2016	28.04.2017	30 507 087		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
7.52 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.04.2016	28.04.2017	30 507 096		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
5.32 % (6.3628 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.06.2016	28.04.2017	30 507 541		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
5.66 % (6.7694 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.06.2016	28.04.2017	30 507 540		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
5.36 % (6.497 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.07.2016	28.04.2017	30 507 580		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
1.46 % (2.5269 % p.a.) Reverse Convertible auf Julius Baer GrpN	CHF	1'000.00	30.09.2016	28.04.2017	32 771 688		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
3.09 % (5.3481 % p.a.) Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	30.09.2016	28.04.2017	32 771 695		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
1.97 % (3.4096 % p.a.) Reverse Convertible auf Sunrise Comm	CHF	1'000.00	30.09.2016	28.04.2017	32 771 684		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
8.74 % (15.4995 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.10.2016	28.04.2017	32 771 721		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
2.42 % (4.3343 % p.a.) Reverse Convertible auf Lindt&SpruengliPS	CHF	1'000.00	07.10.2016	28.04.2017	32 771 740		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
5.18 % (9.5143 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.10.2016	28.04.2017	32 771 766		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
4.13 % (7.5857 % p.a.) Reverse Convertible auf Aryzta N	CHF	1'000.00	12.10.2016	28.04.2017	32 771 767		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
6.45 % (11.8469 % p.a.) Reverse Convertible auf Basilea Pharmaceu N	CHF	1'000.00	12.10.2016	28.04.2017	32 771 769		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
4.56 % (8.4185 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.10.2016	28.04.2017	32 771 776		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
3.34 % (6.5705 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.10.2016	28.04.2017	32 771 851		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
4.16 % (4.4439 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.05.2016	02.05.2017	30 507 320		-	100.000	100.000	02.05.	0.000	Y
9.1 % (9.0748 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.05.2016	03.05.2017	30 507 117		-	100.000	100.000	03.05.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4.72 % (4.7069 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.05.2016	05.05.2017	30 507 131		-	100.000	100.000	05.05.	0.000	Y
11.51 % (8.5789 % p.a.) Reverse Convertible 2015-08.05.17 auf Aktien	CHF	1'000.00	05.01.2016	08.05.2017	25 347 316		-	100.000	100.000	08.05.	0.000	Y
9.28 % (8.0696 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.03.2016	08.05.2017	30 506 898		-	100.000	100.000	08.05.	0.000	Y
3.79 % (3.4985 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien 9.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.04.2016	08.05.2017	30 506 998		-	100.000	100.000		0.000	Y
8.47 % (8.4232 % p.a.) Reverse Convertible auf Basilea Pharmaceu N	CHF	1'000.00	06.05.2016	08.05.2017	30 507 144		-	100.000	100.000	08.05.	0.000	Y
12.2 % (12.1326 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.05.2016	08.05.2017	30 507 145		-	100.000	100.000	08.05.	0.000	Y
10.57 % (10.5116 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.05.2016	08.05.2017	30 507 146		-	100.000	100.000	08.05.	0.000	Y
4.62 % (4.6329 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.05.2016	09.05.2017	30 507 196		-	100.000	100.000	09.05.	0.000	Y
6.71 % (6.7287 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	11.05.2016	10.05.2017	30 507 201		-	100.000	100.000	10.05.	0.000	Y
9 % (9.0251 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.05.2016	11.05.2017	30 507 224		-	100.000	100.000	11.05.	0.000	Y
7.4 % (7.4206 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.05.2016	17.05.2017	30 507 270		-	100.000	100.000	17.05.	0.000	Y
15.06 % (15.1019 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.05.2016	19.05.2017	30 507 289		-	100.000	100.000	19.05.	0.000	Y
4.65 % (4.663 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.05.2016	19.05.2017	30 507 292		-	100.000	100.000	19.05.	0.000	Y
5.01 % (6.68 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.08.2016	22.05.2017	32 771 409		-	100.000	100.000	22.05.	0.000	Y
4 3/4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.05.2016	24.05.2017	30 507 303		-	100.000	100.000	24.05.	0.000	Y
8.31 % (10.5338 % p.a.) Reverse Convertible auf Allianz N	USD	1'000.00	12.08.2016	26.05.2017	32 771 355		-	100.000	100.000	27.02. 26.05.	3.352 3.247	N
5.38 % (4.9662 % p.a.) Reverse Convertible auf LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	29.04.2016	29.05.2017	30 507 100		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
5.2 % (4.8 % p.a.) Reverse Convertible auf Galenica N	CHF	5'000.00	29.04.2016	29.05.2017	30 507 099		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
3.05 % (2.8372 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	02.05.2016	29.05.2017	30 507 110		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
4.39 % (4.0837 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.05.2016	29.05.2017	30 507 118		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
8.37 % (7.8062 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.05.2016	29.05.2017	30 507 122		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
5.99 % (5.601 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.05.2016	29.05.2017	30 507 125		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
5.37 % (5.0213 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	04.05.2016	29.05.2017	30 507 132		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
7.86 % (7.3496 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.05.2016	29.05.2017	30 507 133		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
5.85 % (5.4987 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	06.05.2016	29.05.2017	30 507 149		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
12.92 % (12.1441 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.05.2016	29.05.2017	30 507 154		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
10.63 % (9.9916 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.05.2016	29.05.2017	30 507 153		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
4.72 % (4.4366 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.05.2016	29.05.2017	30 507 152		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
3.84 % (3.6094 % p.a.) Reverse Convertible auf Swisscom N	CHF	1'000.00	06.05.2016	29.05.2017	30 507 150		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
10.17 % (9.5593 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.05.2016	29.05.2017	30 507 148		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
5 1/2 % (5.1697 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.05.2016	29.05.2017	30 507 147		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
4.83 % (4.5399 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	06.05.2016	29.05.2017	30 507 143		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
5.37 % (5.0475 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	06.05.2016	29.05.2017	30 507 142		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
10.82 % (10.1702 % p.a.) Reverse Convertible auf Basilea Pharmaceu N	CHF	1'000.00	06.05.2016	29.05.2017	30 507 158		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
5.91 % (5.5551 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.05.2016	29.05.2017	30 507 160		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
11.76 % (11.0538 % p.a.) Reverse Convertible auf Basilea Pharmaceu N	CHF	1'000.00	06.05.2016	29.05.2017	30 507 161		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
7.15 % (6.7737 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.05.2016	29.05.2017	30 507 179		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
2.93 % (2.7758 % p.a.) Reverse Convertible auf Nestle N	CHF	1'000.00	09.05.2016	29.05.2017	30 507 177		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
5.61 % (5.3147 % p.a.) Reverse Convertible auf Zurich Insur Grp N	CHF	1'000.00	09.05.2016	29.05.2017	30 507 176		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
5.4 % (5.1158 % p.a.) Reverse Convertible auf Swiss Re N	CHF	1'000.00	09.05.2016	29.05.2017	30 507 178		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
13.11 % (12.4528 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	10.05.2016	29.05.2017	30 507 207		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	N
12.8 % (12.1905 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.05.2016	29.05.2017	30 507 206		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
4.84 % (4.6095 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.05.2016	29.05.2017	30 507 211		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
4.65 % (4.4286 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.05.2016	29.05.2017	30 507 209		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
5.71 % (5.4381 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.05.2016	29.05.2017	30 507 205		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
8.51 % (8.1263 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.05.2016	29.05.2017	30 507 220		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
17.02 % (16.2525 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.05.2016	29.05.2017	30 507 223		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
7.29 % (6.9613 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.05.2016	29.05.2017	30 507 221		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
10.42 % (9.9501 % p.a.) Reverse Convertible auf Leonteq N	CHF	1'000.00	12.05.2016	29.05.2017	30 507 219		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
7.02 % (6.7213 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.05.2016	29.05.2017	30 507 230		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
6.18 % (5.917 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.05.2016	29.05.2017	30 507 238		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
7.87 % (7.5351 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.05.2016	29.05.2017	30 507 237		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
6.18 % (5.9806 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	17.05.2016	29.05.2017	30 507 240		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
4.99 % (4.829 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.05.2016	29.05.2017	30 507 241		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
7.57 % (7.3258 % p.a.) Reverse Convertible auf Galenica N	CHF	5'000.00	17.05.2016	29.05.2017	30 507 246		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
3.89 % (3.7645 % p.a.) Reverse Convertible auf Geberit N	CHF	1'000.00	17.05.2016	29.05.2017	30 507 247		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
6.57 % (6.3581 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.05.2016	29.05.2017	30 507 248		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
8.66 % (8.4032 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.05.2016	29.05.2017	30 507 267		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
4 1/4 % (4.124 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	18.05.2016	29.05.2017	30 507 262		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
3.83 % (3.7164 % p.a.) Reverse Convertible auf Geberit N	CHF	1'000.00	18.05.2016	29.05.2017	30 507 264		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
10.08 % (9.7811 % p.a.) Reverse Convertible auf CS Group N	CHF	1'000.00	18.05.2016	29.05.2017	30 507 265		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
5.02 % (4.8712 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.05.2016	29.05.2017	30 507 266		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
7 % (6.8108 % p.a.) Reverse Convertible auf UBS Group N	CHF	1'000.00	19.05.2016	29.05.2017	30 507 279		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
4.52 % (4.4098 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	20.05.2016	29.05.2017	30 507 296		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
10.95 % (10.6829 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.05.2016	29.05.2017	30 507 284		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
11.81 % (11.522 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.05.2016	29.05.2017	30 507 285		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
4.47 % (4.361 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	20.05.2016	29.05.2017	30 507 290		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
9.26 % (9.0341 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.05.2016	29.05.2017	30 507 286		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
4 1/2 % (4.3902 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	20.05.2016	29.05.2017	30 507 293		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
4.62 % (4.5567 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.05.2016	29.05.2017	30 507 309		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
4.32 % (4.2608 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	24.05.2016	29.05.2017	30 507 304		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
8.48 % (8.4099 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.05.2016	29.05.2017	30 507 323		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
8.35 % (8.281 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.05.2016	29.05.2017	30 507 322		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
5.18 % (8.9654 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.11.2016	29.05.2017	32 771 911		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
4.82 % (8.3826 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.11.2016	29.05.2017	32 771 921		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
5.43 % (9.7254 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.11.2016	29.05.2017	32 771 983		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
4.3 % (7.7789 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.11.2016	29.05.2017	32 772 011		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
7.25 % (13.5938 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.11.2016	29.05.2017	32 772 045		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
4.07 % (6.4263 % p.a.) Reverse Convertible auf Alphabet-C	CHF	1'000.00	12.10.2016	30.05.2017	32 771 768		-	100.000	100.000	30.05.	0.000	Y
3.3 % (3.2818 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.05.2016	02.06.2017	30 507 353		-	100.000	100.000	02.06.	0.000	Y
3.7 % (3.6898 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.06.2016	02.06.2017	30 507 361		-	100.000	100.000	02.06.	0.000	Y
6.06 % (5.9934 % p.a.) Reverse Convertible auf Bayer N	EUR	1'000.00	02.06.2016	06.06.2017	30 507 372		-	100.000	100.000	06.06.	0.000	N
7.6 % (7.5372 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.06.2016	06.06.2017	30 507 383		-	100.000	100.000	06.06.	0.000	Y
9.79 % (8.4115 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.04.2016	07.06.2017	30 506 995		-	100.000	100.000	07.06.	0.000	Y
9.4 % (8.6547 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.05.2016	07.06.2017	30 507 164		-	100.000	100.000	07.06.	0.000	Y
6.64 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.06.2016	07.06.2017	30 507 406		-	100.000	100.000	07.06.	0.000	Y
9 1/2 % (8.8831 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.05.2016	08.06.2017	30 507 231		-	100.000	100.000	08.06.	0.000	Y
3.72 % (3.7097 % p.a.) Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	07.06.2016	08.06.2017	30 507 411		-	100.000	100.000	08.06.	0.000	Y
6.23 % (6.2127 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.06.2016	08.06.2017	30 507 405		-	100.000	100.000	08.06.	0.000	Y
3.69 % (4.994 % p.a.) Reverse Convertible auf Sonova Hldg N	CHF	1'000.00	12.09.2016	08.06.2017	32 771 546		-	100.000	100.000	08.06.	0.000	Y
3.34 % (4.9078 % p.a.) Reverse Convertible auf Sonova Hldg N	CHF	1'000.00	03.10.2016	08.06.2017	32 771 700		-	100.000	100.000	08.03. 08.06.	0.000 0.000	N
2.92 % (5.0538 % p.a.) Reverse Convertible auf Sonova Hldg N	CHF	1'000.00	10.11.2016	08.06.2017	32 772 006		-	100.000	100.000	08.03. 08.06.	0.000 0.000	N
4.34 % (4.328 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien 16.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.06.2016	09.06.2017	30 507 420		-	100.000	100.000		0.000	Y
8.84 % (8.8155 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.06.2016	09.06.2017	30 507 423		-	100.000	100.000	09.06.	0.000	Y
9 1/4 % (8.5385 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.05.2016	12.06.2017	30 507 217		-	100.000	100.000	12.06.	0.000	Y
4.84 % (4.8 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.06.2016	12.06.2017	30 507 428		-	100.000	100.000	12.06.	0.000	Y
3.79 % (3.7587 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.06.2016	12.06.2017	30 507 435		-	100.000	100.000	12.06.	0.000	Y
3.77 % (7.4164 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.12.2016	12.06.2017	34 414 146		-	100.000	100.000	12.06.	0.000	Y
3.57 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.06.2016	13.06.2017	30 507 457		-	100.000	100.000	13.06.	0.000	Y
6.08 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.06.2016	15.06.2017	30 507 475		-	100.000	100.000	15.06.	0.000	Y
5.93 % (5.7697 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.06.2016	19.06.2017	30 507 434		-	100.000	100.000	19.06.	0.000	Y
7.53 % (7.551 % p.a.) Reverse Convertible auf Basilea Pharmaceu N	CHF	1'000.00	21.06.2016	20.06.2017	30 507 509		-	100.000	100.000	20.06.	0.000	Y
4.87 % (4.8836 % p.a.) Reverse Convertible auf Basilea Pharmaceu N	CHF	1'000.00	21.06.2016	20.06.2017	30 507 505		-	100.000	100.000	20.06.	0.000	Y
4.87 % (4.8836 % p.a.) Reverse Convertible auf Basilea Pharmaceu N	CHF	1'000.00	21.06.2016	20.06.2017	30 507 504		-	100.000	100.000	20.06.	0.000	Y
10.26 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.06.2016	21.06.2017	30 507 510		-	100.000	100.000	21.06.	0.000	Y
6 3/4 % (5.4977 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.04.2016	23.06.2017	30 506 969		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
7.4 % (6.9016 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.05.2016	23.06.2017	30 507 334		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
7.15 % (6.6684 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.05.2016	23.06.2017	30 507 332		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
4 3/4 % (4.4301 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.05.2016	23.06.2017	30 507 337		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
11.72 % (10.9306 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.05.2016	23.06.2017	30 507 338		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
7.84 % (7.3692 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.05.2016	23.06.2017	30 507 345		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
5.47 % (5.1415 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.05.2016	23.06.2017	30 507 339		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
4.44 % (4.1734 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.05.2016	23.06.2017	30 507 349		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
5.97 % (5.6115 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.05.2016	23.06.2017	30 507 351		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
8.78 % (8.2527 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.05.2016	23.06.2017	30 507 356		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
5.9 % (5.5457 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.05.2016	23.06.2017	30 507 354		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
6.16 % (5.8052 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.06.2016	23.06.2017	30 507 360		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
5.85 % (5.5131 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.06.2016	23.06.2017	30 507 362		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
10.13 % (9.5717 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.06.2016	23.06.2017	30 507 371		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
5.02 % (4.7433 % p.a.) Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	02.06.2016	23.06.2017	30 507 369		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
6.86 % (6.4989 % p.a.) Reverse Convertible auf u-blox Hldg N	CHF	1'000.00	03.06.2016	23.06.2017	30 507 390		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
7.06 % (6.6884 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.06.2016	23.06.2017	30 507 388		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
7.17 % (6.8467 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.06.2016	23.06.2017	30 507 394		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
4.49 % (4.2875 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.06.2016	23.06.2017	30 507 402		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
8.03 % (7.6679 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.06.2016	23.06.2017	30 507 393		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
7.12 % (6.7989 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.06.2016	23.06.2017	30 507 403		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
7.61 % (7.2668 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.06.2016	23.06.2017	30 507 398		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
5.77 % (5.5098 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.06.2016	23.06.2017	30 507 399		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
4.42 % (4.2319 % p.a.) Reverse Convertible auf ABB N	CHF	1'000.00	07.06.2016	23.06.2017	30 507 407		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
1.49 % (1.4266 % p.a.) Reverse Convertible auf Novartis N	CHF	1'000.00	07.06.2016	23.06.2017	30 507 419		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
8 1/2 % (8.16 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	08.06.2016	23.06.2017	30 507 422		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
4.11 % (3.9561 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	09.06.2016	23.06.2017	30 507 427		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
9.26 % (8.9134 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.06.2016	23.06.2017	30 507 440		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
5.05 % (4.861 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.06.2016	23.06.2017	30 507 438		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
8.51 % (8.1914 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	09.06.2016	23.06.2017	30 507 426		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
4.73 % (4.5651 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.06.2016	23.06.2017	30 507 443		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
3.94 % (3.8027 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	10.06.2016	23.06.2017	30 507 441		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
4.58 % (4.4204 % p.a.) Reverse Convertible auf Temenos Grp N	CHF	1'000.00	10.06.2016	23.06.2017	30 507 444		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
2.99 % (2.9092 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.06.2016	23.06.2017	30 507 450		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
5.69 % (5.5512 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.06.2016	23.06.2017	30 507 459		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
4 1/4 % (4.1463 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.06.2016	23.06.2017	30 507 458		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
5.9 % (5.7561 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.06.2016	23.06.2017	30 507 460		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
3.34 % (3.2763 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	16.06.2016	23.06.2017	30 507 477		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
13.13 % (12.9148 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	17.06.2016	23.06.2017	30 507 482		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
4.38 % (4.3082 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.06.2016	23.06.2017	30 507 481		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
2.65 % (2.6066 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.06.2016	23.06.2017	30 507 480		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
11.48 % (11.3851 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.06.2016	23.06.2017	30 507 497		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
3.27 % (3.243 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	20.06.2016	23.06.2017	30 507 500		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
5.01 % (4.9686 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.06.2016	23.06.2017	30 507 490		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
5.33 % (5.286 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.06.2016	23.06.2017	30 507 492		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
4.96 % (4.919 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.06.2016	23.06.2017	30 507 493		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
3.99 % (3.968 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	21.06.2016	23.06.2017	30 507 503		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
5.63 % (5.6144 % p.a.) Reverse Convertible auf Swisscom N	CHF	1'000.00	22.06.2016	23.06.2017	30 507 513		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
4.44 % (4.4277 % p.a.) Reverse Convertible auf Galenica N	CHF	1'000.00	22.06.2016	23.06.2017	30 507 517		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
8.55 % (8.5263 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.06.2016	23.06.2017	30 507 512		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
5.63 % (5.6144 % p.a.) Reverse Convertible auf Swisscom N	CHF	1'000.00	22.06.2016	23.06.2017	30 507 514		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
6 1/2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	23.06.2016	23.06.2017	30 507 520		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
6.27 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.06.2016	23.06.2017	30 507 519		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
6.43 % (6.4479 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	24.06.2016	23.06.2017	30 507 525		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
5.71 % (6.1361 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.07.2016	23.06.2017	32 771 216		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
13.74 % (17.6657 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.09.2016	23.06.2017	32 771 550		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
7.20 % (12.6439 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	10'000.00	28.11.2016	23.06.2017	32 772 107		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
2.52 % (4.4254 % p.a.) Reverse Convertible auf Bucher Ind N 24.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	28.11.2016	23.06.2017	32 772 108		-	100.000	100.000		0.000	Y
3.06 % (5.4266 % p.a.) Reverse Convertible auf Novartis N	CHF	1'000.00	30.11.2016	23.06.2017	32 772 114		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
3.49 % (6.2198 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.12.2016	23.06.2017	34 414 081		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
4.92 % (8.9909 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.12.2016	23.06.2017	34 414 102		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
5.69 % (10.5588 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.12.2016	23.06.2017	34 414 145		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
4.04 % (7.6147 % p.a.) Reverse Convertible auf Novartis N	CHF	1'000.00	12.12.2016	23.06.2017	34 414 152		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
4.06 % (7.6524 % p.a.) Reverse Convertible auf Swiss Re N	CHF	1'000.00	12.12.2016	23.06.2017	34 414 151		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
4.66 % (8.8295 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.12.2016	23.06.2017	34 414 159		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
3.68 % (7.2 % p.a.) Reverse Convertible auf Sonova Hldg N	CHF	1'000.00	19.12.2016	23.06.2017	34 414 185		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
2.18 % (4.2652 % p.a.) Reverse Convertible auf Swiss Prime Site N	CHF	1'000.00	19.12.2016	23.06.2017	34 414 187		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
3.87 % (3.8275 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.06.2016	26.06.2017	30 507 516		-	100.000	100.000	26.06.	0.000	Y
4.18 % (6.9028 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.11.2016	26.06.2017	32 772 059		-	100.000	100.000	26.06.	0.000	Y
6.27 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	27.06.2016	27.06.2017	30 507 533		-	100.000	100.000	27.06.	0.000	Y
6.45 % (6.4321 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.06.2016	28.06.2017	30 507 535		-	100.000	100.000	28.06.	0.000	Y
7.01 % (6.9713 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.07.2016	03.07.2017	30 507 572		-	100.000	100.000	03.07.	0.000	Y
6.46 % Reverse Convertible auf Daimler N	EUR	1'000.00	06.07.2016	06.07.2017	32 771 137		-	100.000	100.000	06.01. 06.07.	0.000 0.000	N
8.9 % (7.6105 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.05.2016	07.07.2017	30 507 165		-	100.000	100.000	07.07.	0.000	Y
12.29 % (10.5847 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.05.2016	07.07.2017	30 507 188		-	100.000	100.000	07.07.	0.000	Y
6.93 % (6.206 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.05.2016	07.07.2017	30 507 314		-	100.000	100.000	07.07.	0.000	Y
7.3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.07.2016	11.07.2017	32 771 166		-	100.000	100.000	11.07.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
8.15 % (5.4333 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.01.2016	18.07.2017	25 347 365		-	100.000	100.000	18.07.	0.000	Y
3.16 % (2.8158 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.06.2016	21.07.2017	30 507 410		-	100.000	100.000	21.07.	0.000	Y
7.63 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.07.2016	21.07.2017	32 771 239		-	100.000	100.000	21.07.	0.000	Y
3.44 % (3.5586 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.08.2016	21.07.2017	32 771 310		-	100.000	100.000	21.07.	0.000	Y
6.06 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.07.2016	25.07.2017	32 771 248		-	100.000	100.000	25.07.	0.000	Y
7.02 % (4.5048 % p.a.) Reverse Convertible 2015-28.07.17 auf Aktien	CHF	1'000.00	07.01.2016	28.07.2017	25 347 320		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
10.03 % (7.5382 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.03.2016	28.07.2017	30 506 961		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
10.67 % (9.7492 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	24.06.2016	28.07.2017	30 507 531		-	100.000	100.000	30.01. 28.07.	0.000 0.000	N
9.84 % (8.9909 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.06.2016	28.07.2017	30 507 524		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
8.46 % (7.7893 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	27.06.2016	28.07.2017	30 507 538		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
8.01 % (7.3749 % p.a.) Reverse Convertible auf UBS Group N	CHF	1'000.00	27.06.2016	28.07.2017	30 507 537		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
3.97 % (3.6646 % p.a.) Reverse Convertible auf Swiss Re N	CHF	1'000.00	28.06.2016	28.07.2017	30 507 550		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
6.71 % (6.2098 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.06.2016	28.07.2017	30 507 562		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
6.53 % (6.0432 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.06.2016	28.07.2017	30 507 561		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
6.46 % (5.9784 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.06.2016	28.07.2017	30 507 560		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
4.65 % (4.3256 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	10'000.00	01.07.2016	28.07.2017	30 507 581		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
9.66 % (8.986 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.07.2016	28.07.2017	30 507 571		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
6.82 % (6.3442 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.07.2016	28.07.2017	30 507 589		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
4.07 % (3.786 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.07.2016	28.07.2017	30 507 577		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
3.65 % (3.3953 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.07.2016	28.07.2017	30 507 586		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
5.8 % (5.4375 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.07.2016	28.07.2017	30 507 595		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
3.9 % (3.6563 % p.a.) Reverse Convertible auf ABB N	CHF	1'000.00	04.07.2016	28.07.2017	30 507 596		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
6.26 % (5.8688 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	04.07.2016	28.07.2017	30 507 601		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
4.89 % (4.5844 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.07.2016	28.07.2017	30 507 602		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
4 % (3 3/4 % p.a.) Reverse Convertible auf ABB N	CHF	1'000.00	04.07.2016	28.07.2017	30 507 592		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
5.51 % (5.1656 % p.a.) Reverse Convertible auf ABB N	CHF	1'000.00	04.07.2016	28.07.2017	30 507 591		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
9.05 % (8.5065 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.07.2016	28.07.2017	32 771 125		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
4.14 % (3.8914 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.07.2016	28.07.2017	32 771 126		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
5.99 % (5.6303 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.07.2016	28.07.2017	32 771 128		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
7.08 % (6.6548 % p.a.) Reverse Convertible auf Aryzta N	CHF	1'000.00	05.07.2016	28.07.2017	32 771 131		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
3.61 % (3.4021 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	06.07.2016	28.07.2017	32 771 141		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
7.1 % (6.6911 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.07.2016	28.07.2017	32 771 135		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
3.64 % (3.4304 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.07.2016	28.07.2017	32 771 136		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
6.12 % (5.7979 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.07.2016	28.07.2017	32 771 149		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
8.28 % (7.9277 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.07.2016	28.07.2017	32 771 172		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
4.61 % (4.4256 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.07.2016	28.07.2017	32 771 183		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
4.07 % (3.9072 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.07.2016	28.07.2017	32 771 184		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
6.04 % (5.7984 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.07.2016	28.07.2017	32 771 182		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
8.04 % (7.7184 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.07.2016	28.07.2017	32 771 186		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
2.76 % (2.6567 % p.a.) Reverse Convertible auf Clariant N	CHF	1'000.00	14.07.2016	28.07.2017	32 771 190		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
4 3/4 % (4.5722 % p.a.) Reverse Convertible auf Richemont N	CHF	1'000.00	14.07.2016	28.07.2017	32 771 189		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
3.39 % (3.2631 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.07.2016	28.07.2017	32 771 193		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
5.67 % (5.4578 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.07.2016	28.07.2017	32 771 187		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
4.61 % (4.4976 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.07.2016	28.07.2017	32 771 226		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
6.84 % (6.6732 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	20'000.00	19.07.2016	28.07.2017	32 771 218		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
2.69 % (2.6244 % p.a.) Reverse Convertible auf Geberit N	CHF	1'000.00	19.07.2016	28.07.2017	32 771 221		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
10.67 % (10.4098 % p.a.) Reverse Convertible auf Meyer Burger N	CHF	1'000.00	19.07.2016	28.07.2017	32 771 222		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
3.52 % (3.4341 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.07.2016	28.07.2017	32 771 228		-	100.000	100.000		0.000	Y
4.82 % (4.7281 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.07.2016	28.07.2017	32 771 237		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
8 1/2 % (8.3607 % p.a.) Reverse Convertible auf Bayer N	USD	1'000.00	22.07.2016	28.07.2017	32 771 242		-	100.000	100.000	30.01. 28.07.	6.765 6.290	N
8.3 % (8.1639 % p.a.) Reverse Convertible auf K+S N	USD	1'000.00	22.07.2016	28.07.2017	32 771 243		-	100.000	100.000	30.01. 28.07.	6.765 6.290	N
10.37 % (10.2 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.07.2016	28.07.2017	32 771 240		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
5.29 % (5.2463 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.07.2016	28.07.2017	32 771 249		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
5.12 % (5.0917 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.07.2016	28.07.2017	32 771 260		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
6.38 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.07.2016	28.07.2017	32 771 286		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
2.4 % Reverse Convertible auf Geberit N	CHF	1'000.00	28.07.2016	28.07.2017	32 771 271		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
2.94 % (3.5517 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.09.2016	28.07.2017	32 771 685		-	100.000	100.000		0.000	Y
6.56 % (8.3155 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.10.2016	28.07.2017	32 771 788		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
6.73 % (8.531 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	10'000.00	14.10.2016	28.07.2017	32 771 786		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
4.59 % (5.8183 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.10.2016	28.07.2017	32 771 785		-	100.000	100.000		0.000	Y
4.05 % (5.3212 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.10.2016	28.07.2017	32 771 839		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
4.2 % (5.6 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.10.2016	28.07.2017	32 771 884		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
4.02 % (6.8914 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.12.2016	28.07.2017	34 414 242		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
2.16 % (3.7206 % p.a.) Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	1'000.00	29.12.2016	28.07.2017	34 414 247		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
4.57 % (8.3939 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.01.2017	28.07.2017	34 414 293		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
2.68 % (4.9224 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.01.2017	28.07.2017	34 414 292		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
4.63 % (8.5041 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.01.2017	28.07.2017	34 414 294		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
2.75 % (5.051 % p.a.) Reverse Convertible auf ABB N	CHF	1'000.00	12.01.2017	28.07.2017	34 414 295		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
3.09 % (5.7046 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.01.2017	28.07.2017	34 414 302		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
3.32 % (6.1292 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.01.2017	28.07.2017	34 414 306		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
5.49 % (10.3476 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.01.2017	28.07.2017	34 414 328		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
4.03 % (7.6762 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.01.2017	28.07.2017	34 414 356		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
5.64 % (11.2177 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.01.2017	28.07.2017	34 414 433		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
6.65 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.08.2016	03.08.2017	32 771 306		-	100.000	100.000	03.08.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.61 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.08.2016	04.08.2017	32 771 323		-	100.000	100.000	04.08.	0.000	Y
10.98 % (8.7645 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.05.2016	07.08.2017	30 507 168		-	100.000	100.000	07.08.	0.000	Y
11.99 % (9.5707 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.05.2016	07.08.2017	30 507 166		-	100.000	100.000	07.08.	0.000	Y
9.12 % (8.5057 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.07.2016	07.08.2017	32 771 159		-	100.000	100.000	07.08.	0.000	Y
8.99 % (8.3845 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.07.2016	07.08.2017	32 771 158		-	100.000	100.000	07.08.	0.000	Y
1.62 % (3.1187 % p.a.) Reverse Convertible auf Galenica N	CHF	1'000.00	30.01.2017	07.08.2017	34 414 455		-	100.000	100.000	07.08.	0.000	Y
5.3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.08.2016	10.08.2017	32 771 339		-	100.000	100.000	10.08.	0.000	Y
9.36 % (8.64 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.07.2016	11.08.2017	32 771 160		-	100.000	100.000	11.08.	0.000	Y
5.42 % Reverse Convertible auf Temenos Grp N	CHF	1'000.00	16.08.2016	16.08.2017	32 771 376		-	100.000	100.000	16.08.	0.000	Y
8.35 % (8.3039 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	50'000.00	19.08.2016	21.08.2017	32 771 397		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
6.39 % (12.7094 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.02.2017	21.08.2017	34 414 671		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
9.98 % Reverse Convertible auf Meyer Burger N	CHF	1'000.00	23.08.2016	23.08.2017	32 771 414		-	100.000	100.000	23.08.	0.000	Y
6.44 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.08.2016	23.08.2017	32 771 413		-	100.000	100.000	23.08.	0.000	Y
3.23 % (10.1113 % p.a.) Reverse Convertible auf ArcelorMittal Reg	CHF	1'000.00	28.04.2017	23.08.2017	34 415 224		-	100.000	100.000	23.08.	0.000	Y
4.29 % (4.0429 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.08.2016	25.08.2017	32 771 305		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
2.63 % (2.485 % p.a.) Reverse Convertible auf EMS-CHEM HLDG N	CHF	1'000.00	04.08.2016	25.08.2017	32 771 322		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
6.62 % (6.2551 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.08.2016	25.08.2017	32 771 324		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
5.37 % (5.074 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.08.2016	25.08.2017	32 771 320		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
2.56 % (2.4189 % p.a.) Reverse Convertible auf Novartis N	CHF	1'000.00	04.08.2016	25.08.2017	32 771 321		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
5.62 % (5.3952 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.08.2016	25.08.2017	32 771 338		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
4.17 % (4.0139 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.08.2016	25.08.2017	32 771 345		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
12.54 % (12.1029 % p.a.) Reverse Convertible auf Leonteq N	CHF	1'000.00	12.08.2016	25.08.2017	32 771 353		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
3.73 % (3.6292 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.08.2016	25.08.2017	32 771 370		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
6.38 % (6.2413 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.08.2016	25.08.2017	32 771 380		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
7.05 % (6.9155 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	18.08.2016	25.08.2017	32 771 393		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
3 1/2 % (3.4332 % p.a.) Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	18.08.2016	25.08.2017	32 771 391		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
5.93 % (5.8169 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.08.2016	25.08.2017	32 771 388		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
1.93 % (1.8932 % p.a.) Reverse Convertible auf Nestle N	CHF	1'000.00	18.08.2016	25.08.2017	32 771 392		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
2.6 % (2.5504 % p.a.) Reverse Convertible auf Geberit N	CHF	1'000.00	18.08.2016	25.08.2017	32 771 390		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
8.09 % (7.9357 % p.a.) Reverse Convertible auf CS Group N	CHF	1'000.00	18.08.2016	25.08.2017	32 771 394		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
3.94 % (3.9074 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.08.2016	25.08.2017	32 771 405		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
6.27 % (6.2354 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.08.2016	25.08.2017	32 771 410		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
9.33 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.08.2016	25.08.2017	32 771 428		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
5.46 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.08.2016	25.08.2017	32 771 426		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
4.28 % (4.2919 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.08.2016	25.08.2017	32 771 432		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
3.91 % (6.4569 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.01.2017	25.08.2017	34 414 330		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
3.77 % (6.2257 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.01.2017	25.08.2017	34 414 329		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
6 % (10.5882 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.02.2017	25.08.2017	34 414 488		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
1.79 % (3.1588 % p.a.) Reverse Convertible auf Geberit N	CHF	1'000.00	01.02.2017	25.08.2017	34 414 483		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4.1 % (7.2709 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.02.2017	25.08.2017	34 414 510		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
1.7 % (3.0148 % p.a.) Reverse Convertible auf Straumann Hldg N	CHF	1'000.00	02.02.2017	25.08.2017	34 414 508		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
4.15 % (7.3596 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.02.2017	25.08.2017	34 414 511		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
2.56 % (4.5399 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.02.2017	25.08.2017	34 414 493		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
2.69 % (4.7941 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.02.2017	25.08.2017	34 414 524		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
7.44 % (13.4593 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.02.2017	25.08.2017	34 414 540		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
3.93 % (7.1817 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.02.2017	25.08.2017	34 414 569		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
3.91 % (7.1452 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.02.2017	25.08.2017	34 414 570		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
3.89 % (7.1086 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.02.2017	25.08.2017	34 414 568		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
4.71 % (8.651 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.02.2017	25.08.2017	34 414 581		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
9.77 % (17.9449 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.02.2017	25.08.2017	34 414 580		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
2.5 % (4.5918 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.02.2017	25.08.2017	34 414 582		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
5.02 % (9.4125 % p.a.) Reverse Convertible auf ARYZTA N	CHF	1'000.00	13.02.2017	25.08.2017	34 414 602		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
7.71 % (14.4563 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.02.2017	25.08.2017	34 414 604		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
2.46 % (4.6366 % p.a.) Reverse Convertible auf Swisscom N	CHF	1'000.00	14.02.2017	25.08.2017	34 414 624		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
5.2 % (9.801 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.02.2017	25.08.2017	34 414 621		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
2.08 % (3.9411 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.02.2017	25.08.2017	34 414 629		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
4.34 % (8.2667 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.02.2017	25.08.2017	34 414 651		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
2.94 % (5.7211 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.02.2017	25.08.2017	34 414 677		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
3.43 % (6.8221 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.02.2017	25.08.2017	34 414 748		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
10.26 % (10.2033 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.08.2016	28.08.2017	32 771 436		-	100.000	100.000	28.08.	0.000	Y
4.29 % (7.6455 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.02.2017	29.08.2017	34 414 549		-	100.000	100.000	29.08.	0.000	Y
12.06 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.08.2016	30.08.2017	32 771 451		-	100.000	100.000	30.08.	0.000	Y
13.52 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.08.2016	30.08.2017	32 771 448		-	100.000	100.000	30.08.	0.000	Y
14.45 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	31.08.2016	31.08.2017	32 771 457		-	100.000	100.000	31.08.	0.000	Y
6 3/4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	31.08.2016	31.08.2017	32 771 458		-	100.000	100.000	31.08.	0.000	Y
9.87 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	31.08.2016	31.08.2017	32 771 459		-	100.000	100.000	31.08.	0.000	Y
11.02 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.09.2016	01.09.2017	32 771 465		-	100.000	100.000	01.09.	0.000	Y
3.7 % (3.7103 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.09.2016	01.09.2017	32 771 487		-	100.000	100.000	01.09.	0.000	Y
11.17 % (11.1083 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.09.2016	04.09.2017	32 771 477		-	100.000	100.000	04.09.	0.000	Y
11.1 % (11.0387 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.09.2016	04.09.2017	32 771 483		-	100.000	100.000	04.09.	0.000	Y
5.23 % (5.2011 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.09.2016	04.09.2017	32 771 480		-	100.000	100.000	04.09.	0.000	Y
7.78 % (7.737 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.09.2016	04.09.2017	32 771 476		-	100.000	100.000	04.09.	0.000	Y
11.54 % (8.7094 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.05.2016	06.09.2017	30 507 186		-	100.000	100.000	06.09.	0.000	Y
10.29 % (7.7987 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.05.2016	06.09.2017	30 507 215		-	100.000	100.000	06.09.	0.000	Y
11.01 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.09.2016	06.09.2017	32 771 505		-	100.000	100.000	06.09.	0.000	Y
6.06 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.09.2016	06.09.2017	32 771 504		-	100.000	100.000	06.09.	0.000	Y
11.59 % (8.6564 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.05.2016	08.09.2017	30 507 170		-	100.000	100.000	08.09.	0.000	Y
6.81 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.09.2016	08.09.2017	32 771 521		-	100.000	100.000	08.09.	0.000	Y
11.04 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.09.2016	12.09.2017	32 771 547		-	100.000	100.000	12.09.	0.000	Y
5.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.09.2016	13.09.2017	32 771 552		-	100.000	100.000	13.09.	0.000	Y
6.95 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.09.2016	14.09.2017	32 771 559		-	100.000	100.000	14.09.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.14 % (5.1116 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.09.2016	18.09.2017	32 771 578		-	100.000	100.000	18.09.	0.000	Y
5.37 % (5.3403 % p.a.) Reverse Convertible auf Burckhardt Compre N	CHF	1'000.00	16.09.2016	18.09.2017	32 771 569		-	100.000	100.000	18.09.	0.000	Y
5.9 % (5.5026 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.08.2016	22.09.2017	32 771 434		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
7.64 % (7.1254 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	26.08.2016	22.09.2017	32 771 439		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
4.38 % (4.117 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.08.2016	22.09.2017	32 771 446		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
3.64 % (3.4214 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.08.2016	22.09.2017	32 771 440		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
5.85 % (5.4987 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.08.2016	22.09.2017	32 771 441		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
5.6 % (5.2775 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.08.2016	22.09.2017	32 771 450		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
7.11 % (6.7005 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.08.2016	22.09.2017	32 771 455		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
5.06 % (4.7811 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.09.2016	22.09.2017	32 771 467		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
8.35 % (7.8898 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.09.2016	22.09.2017	32 771 473		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
4.01 % (3.789 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.09.2016	22.09.2017	32 771 469		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
6.79 % (6.4157 % p.a.) Reverse Convertible auf Actelion N 26.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	01.09.2016	22.09.2017	32 771 470		-	100.000	100.000	26.06.	0.000	Y
9.73 % (9.1937 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.09.2016	22.09.2017	32 771 474		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
2.58 % (2.4378 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.09.2016	22.09.2017	32 771 468		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
14.45 % (13.6535 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.09.2016	22.09.2017	32 771 472		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
8.87 % (8.3811 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.09.2016	22.09.2017	32 771 464		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
9.69 % (9.18 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.09.2016	22.09.2017	32 771 478		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
4.32 % (4.0926 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.09.2016	22.09.2017	32 771 485		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
7 1/4 % (6.8684 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.09.2016	22.09.2017	32 771 484		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
4.06 % (3.8463 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.09.2016	22.09.2017	32 771 479		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
5.81 % (5.548 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.09.2016	22.09.2017	32 771 493		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
9.12 % (8.7088 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.09.2016	22.09.2017	32 771 492		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
6.29 % (6.0064 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.09.2016	22.09.2017	32 771 488		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
8.34 % (7.9639 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.09.2016	22.09.2017	32 771 490		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
7.88 % (7.5447 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.09.2016	22.09.2017	32 771 508		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
5.07 % (4.8672 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	07.09.2016	22.09.2017	32 771 511		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
7.17 % (6.8832 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.09.2016	22.09.2017	32 771 514		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
8.05 % (7.728 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.09.2016	22.09.2017	32 771 515		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
5.35 % (5.136 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.09.2016	22.09.2017	32 771 518		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
5.94 % (5.7176 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.09.2016	22.09.2017	32 771 534		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
8.09 % (7.7872 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.09.2016	22.09.2017	32 771 525		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
3.95 % (3.8123 % p.a.) Reverse Convertible auf Novartis N	CHF	1'000.00	09.09.2016	22.09.2017	32 771 539		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
6.45 % (6.2757 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.09.2016	22.09.2017	32 771 545		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
2.19 % (2.1308 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.09.2016	22.09.2017	32 771 543		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
6.32 % (6.1659 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.09.2016	22.09.2017	32 771 548		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.09 % (4.9793 % p.a.) Reverse Convertible auf LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	14.09.2016	22.09.2017	32 771 557		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
7.05 % (6.8967 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.09.2016	22.09.2017	32 771 556		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
5.35 % (5.248 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.09.2016	22.09.2017	32 771 565		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
7.27 % (7.1313 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.09.2016	22.09.2017	32 771 566		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
5.97 % (5.8721 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	16.09.2016	22.09.2017	32 771 572		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
5.37 % (5.282 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.09.2016	22.09.2017	32 771 571		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
9.31 % (9.2331 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.09.2016	22.09.2017	32 771 586		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
10.16 % (10.076 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.09.2016	22.09.2017	32 771 585		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
5.9 % (5.8674 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.09.2016	22.09.2017	32 771 598		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
5.56 % (5.5293 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.09.2016	22.09.2017	32 771 600		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
7.37 % (7.3293 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.09.2016	22.09.2017	32 771 599		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
5.85 % (5.8177 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.09.2016	22.09.2017	32 771 593		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
4.56 % (4.5474 % p.a.) Reverse Convertible auf Novartis N	CHF	1'000.00	21.09.2016	22.09.2017	32 771 608		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
7.12 % (7.1003 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.09.2016	22.09.2017	32 771 610		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
3.06 % (3.0515 % p.a.) Reverse Convertible auf Nestle N	CHF	1'000.00	21.09.2016	22.09.2017	32 771 609		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
6.14 % Reverse Convertible auf LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	22.09.2016	22.09.2017	32 771 631		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
6.41 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	22.09.2016	22.09.2017	32 771 613		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
5.34 % Reverse Convertible auf Adecco Group N	CHF	1'000.00	22.09.2016	22.09.2017	32 771 632		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
3.58 % Reverse Convertible auf Basilea Pharmaceu N	CHF	1'000.00	22.09.2016	22.09.2017	32 771 628		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
4.25 % (6.0956 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.01.2017	22.09.2017	34 414 286		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
4.82 % (6.9131 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.01.2017	22.09.2017	34 414 282		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
5.44 % (7.8024 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.01.2017	22.09.2017	34 414 283		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
4.4 % (6.7119 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.01.2017	22.09.2017	34 414 414		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
1.77 % (3.1545 % p.a.) Reverse Convertible auf Siemens N	CHF	1'000.00	28.02.2017	22.09.2017	34 414 764		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
2.06 % (3.6713 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.02.2017	22.09.2017	34 414 767		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
3.55 % (6.39 % p.a.) Reverse Convertible auf u-blox Hldg N	CHF	1'000.00	02.03.2017	22.09.2017	34 414 788		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
3.69 % (6.8829 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.03.2017	22.09.2017	34 414 869		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
1.31 % (2.4435 % p.a.) Reverse Convertible auf Geberit N	CHF	1'000.00	09.03.2017	22.09.2017	34 414 873		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
9.79 % (18.2611 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.03.2017	22.09.2017	34 414 875		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
5.47 % (5.4398 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.09.2016	25.09.2017	32 771 642		-	100.000	100.000	25.09.	0.000	Y
4.26 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	26.09.2016	26.09.2017	32 771 652		-	100.000	100.000	26.09.	0.000	Y
5.47 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.09.2016	26.09.2017	32 771 654		-	100.000	100.000	26.09.	0.000	Y
5.36 % (5.8473 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.10.2016	27.09.2017	32 771 876		-	100.000	100.000	27.09.	0.000	Y
4.93 % (4.9437 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	30.09.2016	29.09.2017	32 771 689		-	100.000	100.000	29.09.	0.000	Y
10.59 % (8.3789 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.07.2016	06.10.2017	30 507 590		-	100.000	100.000	06.10.	0.000	Y
6.09 % (4.9267 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.07.2016	06.10.2017	32 771 162		-	100.000	100.000	06.10.	0.000	Y
5.98 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.10.2016	06.10.2017	32 771 727		-	100.000	100.000	06.10.	0.000	Y
6.57 % (6.3924 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	29.09.2016	09.10.2017	32 771 673		-	100.000	100.000	09.10.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4.67 % (4.6187 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.10.2016	09.10.2017	32 771 719		-	100.000	100.000	09.10.	0.000	Y
6.23 % (8.1854 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.01.2017	10.10.2017	34 414 268		-	100.000	100.000	10.10.	0.000	Y
4.85 % Reverse Convertible auf ABB N	CHF	1'000.00	13.10.2016	13.10.2017	32 771 782		-	100.000	100.000	13.10.	0.000	Y
5.87 % (5.4605 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.09.2016	17.10.2017	32 771 596		-	100.000	100.000	17.10.	0.000	Y
3.7 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.10.2016	18.10.2017	32 771 800		-	100.000	100.000	18.10.	0.000	Y
4.07 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.10.2016	18.10.2017	32 771 801		-	100.000	100.000	18.10.	0.000	Y
8.65 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.10.2016	19.10.2017	32 771 810		-	100.000	100.000	19.10.	0.000	Y
4.09 % (4.0674 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.10.2016	23.10.2017	32 771 824		-	100.000	100.000	23.10.	0.000	Y
4.7 % (4.674 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.10.2016	23.10.2017	32 771 826		-	100.000	100.000	23.10.	0.000	Y
4.4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.10.2016	24.10.2017	32 771 832		-	100.000	100.000	24.10.	0.000	Y
4.73 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.10.2016	24.10.2017	32 771 841		-	100.000	100.000	24.10.	0.000	Y
3.59 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	24.10.2016	24.10.2017	32 771 840		-	100.000	100.000	24.10.	0.000	Y
5.28 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.10.2016	24.10.2017	32 771 834		-	100.000	100.000	24.10.	0.000	Y
3.96 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.10.2016	25.10.2017	32 771 846		-	100.000	100.000	25.10.	0.000	Y
2.39 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	26.10.2016	26.10.2017	32 771 857		-	100.000	100.000	26.10.	0.000	Y
3.71 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	26.10.2016	26.10.2017	32 771 855		-	100.000	100.000	26.10.	0.000	Y
4.77 % Reverse Convertible auf LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	26.10.2016	26.10.2017	32 771 862		-	100.000	100.000	26.10.	0.000	Y
6.11 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.10.2016	26.10.2017	32 771 863		-	100.000	100.000	26.10.	0.000	Y
3.29 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	26.10.2016	26.10.2017	32 771 861		-	100.000	100.000	26.10.	0.000	Y
11.97 % (7.98 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.04.2016	27.10.2017	30 507 074		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
5.57 % (5.0893 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	50'000.00	23.09.2016	27.10.2017	32 771 635		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
4.92 % (4.4954 % p.a.) Reverse Convertible auf Adecco Group N	CHF	1'000.00	23.09.2016	27.10.2017	32 771 639		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
4.03 % (3.6822 % p.a.) Reverse Convertible auf Swiss Re N	CHF	1'000.00	23.09.2016	27.10.2017	32 771 637		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
2.87 % (2.6223 % p.a.) Reverse Convertible auf SGS N	CHF	5'000.00	23.09.2016	27.10.2017	32 771 638		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
7.19 % (6.6199 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.09.2016	27.10.2017	32 771 649		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
7.15 % (6.5831 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.09.2016	27.10.2017	32 771 651		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
6.18 % (5.69 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.09.2016	27.10.2017	32 771 647		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
10.19 % (9.4062 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.09.2016	27.10.2017	32 771 656		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
8.13 % (7.5046 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.09.2016	27.10.2017	32 771 666		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
5.89 % (5.4509 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.09.2016	27.10.2017	32 771 670		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
6.03 % (5.5948 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.09.2016	27.10.2017	32 771 680		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
6.2 % (5.7526 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.09.2016	27.10.2017	32 771 681		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
7.07 % (6.5767 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.09.2016	27.10.2017	32 771 694		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
4.43 % (4.1531 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.10.2016	27.10.2017	32 771 697		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
7.46 % (7.012 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.10.2016	27.10.2017	32 771 701		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
6.16 % (5.7901 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.10.2016	27.10.2017	32 771 712		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
16 % (15.0785 % p.a.) Reverse Convertible auf Leonteq N	CHF	1'000.00	05.10.2016	27.10.2017	32 771 718		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
6.53 % (6.1539 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.10.2016	27.10.2017	32 771 720		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
7.69 % (7.2661 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.10.2016	27.10.2017	32 771 734		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
5.16 % (4.8756 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.10.2016	27.10.2017	32 771 733		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
11.12 % (10.6186 % p.a.) Reverse Convertible auf Leonteq N	CHF	1'000.00	10.10.2016	27.10.2017	32 771 751		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
5.65 % (5.424 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.10.2016	27.10.2017	32 771 770		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
6.27 % (6.0353 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.10.2016	27.10.2017	32 771 781		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
9.99 % (9.616 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.10.2016	27.10.2017	32 771 779		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
6.03 % (5.8043 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.10.2016	27.10.2017	32 771 777		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
10.03 % (9.6804 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.10.2016	27.10.2017	32 771 789		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
3.88 % (3.7448 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	14.10.2016	27.10.2017	32 771 784		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
8.61 % (8.3099 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.10.2016	27.10.2017	32 771 790		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
7.01 % (6.8205 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.10.2016	27.10.2017	32 771 796		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
4.41 % (4.3259 % p.a.) Reverse Convertible auf Basilea Pharmaceu N	CHF	1'000.00	20.10.2016	27.10.2017	32 771 820		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
4.23 % (4.1493 % p.a.) Reverse Convertible auf Richemont N	CHF	1'000.00	20.10.2016	27.10.2017	32 771 819		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
5.66 % (5.5672 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.10.2016	27.10.2017	32 771 828		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
5.55 % (5.5041 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.10.2016	27.10.2017	32 771 842		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
6.26 % (6.2254 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.10.2016	27.10.2017	32 771 852		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
3.9 % (3.8785 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.10.2016	27.10.2017	32 771 847		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
7.17 % (7.1304 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.10.2016	27.10.2017	32 771 850		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
4.83 % (4.8166 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	100'000.00	26.10.2016	27.10.2017	32 771 859		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
4.8 % (4.7867 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.10.2016	27.10.2017	32 771 854		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
4.34 % (4.328 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.10.2016	27.10.2017	32 771 860		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
9.48 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.10.2016	27.10.2017	32 771 870		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
7.52 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.10.2016	27.10.2017	32 771 869		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
4.85 % Reverse Convertible auf Fresenius	CHF	1'000.00	27.10.2016	27.10.2017	32 771 879		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
7.85 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.10.2016	27.10.2017	32 771 867		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
5.22 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.10.2016	27.10.2017	32 771 868		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
4.63 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	27.10.2016	27.10.2017	32 771 873		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
12.58 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.10.2016	27.10.2017	32 771 871		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
6.03 % (6.7838 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.12.2016	27.10.2017	34 414 116		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
3.51 % (4.1566 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	23.12.2016	27.10.2017	34 414 216		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
10.28 % (12.5878 % p.a.) Reverse Convertible 2016-27.10.17 auf Aktien	CHF	1'000.00	03.01.2017	27.10.2017	34 414 254		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
7.35 % (9.518 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.01.2017	27.10.2017	34 414 363		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
2.71 % (4.5589 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.03.2017	27.10.2017	34 414 963		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
3.47 % (5.9486 % p.a.) Reverse Convertible auf CS Group N	CHF	1'000.00	27.03.2017	27.10.2017	34 414 987		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
3.06 % (5.3217 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.03.2017	27.10.2017	34 415 035		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
2.88 % (5.0824 % p.a.) Reverse Convertible auf Geberit N	CHF	5'000.00	03.04.2017	27.10.2017	34 415 053		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
3.29 % (5.8059 % p.a.) Reverse Convertible auf Straumann Hldg N	CHF	5'000.00	03.04.2017	27.10.2017	34 415 055		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
3.3 % (5.8235 % p.a.) Reverse Convertible auf Bayer N	CHF	1'000.00	03.04.2017	27.10.2017	34 415 059		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
3.98 % (7.0235 % p.a.) Reverse Convertible auf Adecco Group N	CHF	5'000.00	03.04.2017	27.10.2017	34 415 054		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
3.55 % (6.2956 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.04.2017	27.10.2017	34 415 063		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
7.44 % (13.3254 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	06.04.2017	27.10.2017	34 415 079		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
2.19 % (4.0431 % p.a.) Reverse Convertible auf Swisscom N	CHF	1'000.00	12.04.2017	27.10.2017	34 415 105		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
3.28 % (6.0554 % p.a.) Reverse Convertible auf Nestle N	CHF	1'000.00	12.04.2017	27.10.2017	34 415 106		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
9.31 % (17.7333 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.04.2017	27.10.2017	34 415 113		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
7.95 % (15.2234 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.04.2017	27.10.2017	34 415 117		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
12.03 % (23.1594 % p.a.) Reverse Convertible auf Leonteq N	CHF	1'000.00	20.04.2017	27.10.2017	34 415 126		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
4.22 % (8.3016 % p.a.) Reverse Convertible auf LafargeHolcim N	CHF	5'000.00	24.04.2017	27.10.2017	34 415 151		-	100.000	100.000	27.07. 27.10.	0.000 0.000	N
4.6 % (4.5746 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.10.2016	30.10.2017	32 771 886		-	100.000	100.000	30.10.	0.000	Y
5.73 % (5.6983 % p.a.) Reverse Convertible auf Bayer N	CHF	1'000.00	28.10.2016	30.10.2017	32 771 892		-	100.000	100.000	30.10.	0.000	Y
3 1/4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.10.2016	31.10.2017	32 771 897		-	100.000	100.000	31.10.	0.000	Y
3.71 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	31.10.2016	31.10.2017	32 771 902		-	100.000	100.000	31.10.	0.000	Y
5.98 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	10'000.00	01.11.2016	01.11.2017	32 771 916		-	100.000	100.000	01.11.	0.000	Y
6.67 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.11.2016	01.11.2017	32 771 917		-	100.000	100.000	01.11.	0.000	Y
3.3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.11.2016	03.11.2017	32 771 956		-	100.000	100.000	03.11.	0.000	Y
6.16 % Reverse Convertible auf ABB N	CHF	1'000.00	03.11.2016	03.11.2017	32 771 945		-	100.000	100.000	03.11.	0.000	Y
6.16 % Reverse Convertible auf ABB N	CHF	1'000.00	03.11.2016	03.11.2017	32 771 946		-	100.000	100.000	03.11.	0.000	Y
4.53 % (4.505 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.11.2016	06.11.2017	32 771 959		-	100.000	100.000	06.11.	0.000	Y
6.19 % (6.1558 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	04.11.2016	06.11.2017	32 771 965		-	100.000	100.000	06.11.	0.000	Y
6.26 % (6.2254 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	04.11.2016	06.11.2017	32 771 963		-	100.000	100.000		0.000	Y
10 % (9.4737 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.10.2016	07.11.2017	32 771 793		-	100.000	100.000	07.11.	0.000	Y
4.55 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	07.11.2016	07.11.2017	32 771 971		-	100.000	100.000	07.11.	0.000	Y
5.15 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.11.2016	07.11.2017	32 771 975		-	100.000	100.000	07.11.	0.000	Y
4.34 % Reverse Convertible auf Bayer N	CHF	1'000.00	08.11.2016	08.11.2017	32 771 982		-	100.000	100.000	08.11.	0.000	Y
3.89 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.11.2016	09.11.2017	32 771 988		-	100.000	100.000	09.11.	0.000	Y
5.78 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	10.11.2016	10.11.2017	32 772 003		-	100.000	100.000	10.11.	0.000	Y
4.65 % (4.7422 % p.a.) Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	17.11.2016	10.11.2017	32 772 053		-	100.000	100.000	10.11.	0.000	Y
4.52 % (4.495 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.11.2016	13.11.2017	32 772 013		-	100.000	100.000	13.11.	0.000	Y
Reverse Convertible auf LafargeHolcim N	CHF	47.90	16.11.2016	13.11.2017	32 772 042		-	100.000	100.000		0.000	N
6.37 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.11.2016	14.11.2017	32 772 028		-	100.000	100.000	14.11.	0.000	Y
9.26 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.11.2016	14.11.2017	32 772 032		-	100.000	100.000	14.11.	0.000	Y
5.80 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.11.2016	21.11.2017	32 772 069		-	100.000	100.000	21.11.	0.000	Y
7.02 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.11.2016	23.11.2017	32 772 083		-	100.000	100.000	23.11.	0.000	Y
9.98 % (6.4387 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.05.2016	24.11.2017	30 507 141		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
5.78 % (5.3907 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	28.10.2016	24.11.2017	32 771 883		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
3.51 % (3.2736 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.10.2016	24.11.2017	32 771 887		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
6.08 % (5.6705 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.10.2016	24.11.2017	32 771 888		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
4.21 % (3.9264 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	28.10.2016	24.11.2017	32 771 890		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
5.28 % (4.9244 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.10.2016	24.11.2017	32 771 889		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
5.26 % (4.9313 % p.a.) Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	31.10.2016	24.11.2017	32 771 903		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
7.38 % (6.9188 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.10.2016	24.11.2017	32 771 907		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
7.11 % (6.6656 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.10.2016	24.11.2017	32 771 906		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
4.46 % (4.1813 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.10.2016	24.11.2017	32 771 905		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
7.12 % (6.675 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.10.2016	24.11.2017	32 771 894		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
5.37 % (5.0475 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.11.2016	24.11.2017	32 771 912		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
6.42 % (6.0345 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.11.2016	24.11.2017	32 771 915		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
7.1 % (6.6911 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	02.11.2016	24.11.2017	32 771 923		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
6.32 % (5.956 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.11.2016	24.11.2017	32 771 924		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
3.31 % (3.1194 % p.a.) Reverse Convertible auf Actelion N 26.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	02.11.2016	24.11.2017	32 771 926		-	100.000	100.000	26.06.	0.000	Y
5.3 % (4.9948 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.11.2016	24.11.2017	32 771 925		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
4.97 % (4.6838 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.11.2016	24.11.2017	32 771 922		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
7.32 % (6.8984 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.11.2016	24.11.2017	32 771 927		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
5.52 % (5.2157 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	03.11.2016	24.11.2017	32 771 955		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
7.24 % (6.8409 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	03.11.2016	24.11.2017	32 771 943		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
4.9 % (4.6299 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.11.2016	24.11.2017	32 771 954		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
4.39 % (4.148 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.11.2016	24.11.2017	32 771 939		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
3.29 % (3.1087 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.11.2016	24.11.2017	32 771 958		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
4.92 % (4.6488 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.11.2016	24.11.2017	32 771 944		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
4.61 % (4.3559 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.11.2016	24.11.2017	32 771 938		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
5.13 % (4.8472 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.11.2016	24.11.2017	32 771 953		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
4.86 % (4.5921 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.11.2016	24.11.2017	32 771 940		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
4.35 % (4.1538 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.11.2016	24.11.2017	32 771 977		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
3.3 % (3.1512 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.11.2016	24.11.2017	32 771 972		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
3.58 % (3.4186 % p.a.) Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	07.11.2016	24.11.2017	32 771 970		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
8.16 % (7.8128 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien 24.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.11.2016	24.11.2017	32 771 986		-	100.000	100.000		0.000	Y
6.21 % (5.9457 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.11.2016	24.11.2017	32 771 985		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
5.04 % (4.8255 % p.a.) Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	08.11.2016	24.11.2017	32 771 981		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
3.96 % (3.7915 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.11.2016	24.11.2017	32 771 978		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
11.69 % (11.2224 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.11.2016	24.11.2017	32 771 999		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
4.85 % (4.656 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.11.2016	24.11.2017	32 771 987		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
9.41 % (9.0336 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.11.2016	24.11.2017	32 771 990		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
5.3 % (5.1016 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.11.2016	24.11.2017	32 772 012		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
11.46 % (11.0606 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.11.2016	24.11.2017	32 772 023		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
4.95 % (4.7775 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.11.2016	24.11.2017	32 772 020		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
6.00 % (5.8378 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.11.2016	24.11.2017	32 772 027		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
5.65 % (5.5122 % p.a.) Reverse Convertible auf Geberit N	CHF	1'000.00	15.11.2016	24.11.2017	32 772 033		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
8.50 % (8.2927 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.11.2016	24.11.2017	32 772 034		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
11.52 % (11.2696 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.11.2016	24.11.2017	32 772 038		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
7.75 % (7.5815 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.11.2016	24.11.2017	32 772 040		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
3.70 % (3.6294 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.11.2016	24.11.2017	32 772 048		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
3.86 % (3.7864 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.11.2016	24.11.2017	32 772 049		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
5.08 % (4.9831 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.11.2016	24.11.2017	32 772 054		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
6.22 % (6.1014 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.11.2016	24.11.2017	32 772 047		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
2.70 % (2.6485 % p.a.) Reverse Convertible auf Swisscom N	CHF	1'000.00	17.11.2016	24.11.2017	32 772 052		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
13.18 % (12.9286 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.11.2016	24.11.2017	32 772 051		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
6.36 % (6.2557 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.11.2016	24.11.2017	32 772 061		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
4.76 % (4.682 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	18.11.2016	24.11.2017	32 772 058		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
6.56 % (6.5238 % p.a.) Reverse Convertible auf Georg Fischer N	CHF	1'000.00	22.11.2016	24.11.2017	32 772 074		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
6.15 % (6.133 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	23.11.2016	24.11.2017	32 772 081		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
6.86 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	24.11.2016	24.11.2017	32 772 089		-	100.000	100.000	24.05. 24.11.	0.000 0.000	N
4.03 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	24.11.2016	24.11.2017	32 772 084		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
3.19 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	24.11.2016	24.11.2017	32 772 087		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
3.38 % Reverse Convertible auf Baloise Hldg N	CHF	1'000.00	24.11.2016	24.11.2017	32 772 088		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
6.35 % (7.7755 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.01.2017	24.11.2017	34 414 441		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
6.34 % (7.7633 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.01.2017	24.11.2017	34 414 442		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
3.98 % (4.9068 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.02.2017	24.11.2017	34 414 504		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
6.52 % (8.066 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.02.2017	24.11.2017	34 414 522		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
3.07 % (4.3172 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.03.2017	24.11.2017	34 414 859		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
3.62 % (5.4075 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.03.2017	24.11.2017	34 414 964		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
8.01 % (13.9981 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.04.2017	24.11.2017	34 415 209		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
5.27 % (9.486 % p.a.) Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	1'000.00	04.05.2017	24.11.2017	34 415 242		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
3.47 % (6.3735 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.05.2017	24.11.2017	34 415 278		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
1.59 % (2.9354 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.05.2017	24.11.2017	34 415 289		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
4.75 % (8.8144 % p.a.) Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	1'000.00	10.05.2017	24.11.2017	34 415 302		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
7.15 % (13.4063 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.05.2017	24.11.2017	34 415 324		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
3.52 % (6.8129 % p.a.) Reverse Convertible auf Carrefour P	EUR	5'000.00	18.05.2017	24.11.2017	34 415 362		-	100.000	100.000	24.08. 24.11.	0.000 0.000	N
4.76 % (9.4674 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.05.2017	24.11.2017	34 415 383		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
6 3/4 % (6.2791 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.10.2016	27.11.2017	32 771 896		-	100.000	100.000	27.11.	0.000	Y
10.39 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.11.2016	28.11.2017	32 772 097		-	100.000	100.000	28.11.	0.000	Y
6.3 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	29.11.2016	29.11.2017	32 772 113		-	100.000	100.000	29.11.	0.000	Y
3.9 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	30.11.2016	30.11.2017	32 772 117		-	100.000	100.000	30.11.	0.000	Y
5.83 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.11.2016	30.11.2017	32 772 115		-	100.000	100.000	30.11.	0.000	Y
4.71 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.11.2016	30.11.2017	32 772 121		-	100.000	100.000	30.11.	0.000	Y
3.69 % (3.7003 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	02.12.2016	01.12.2017	34 414 087		-	100.000	100.000	01.12.	0.000	Y
2.14 % (2.1282 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	50'000.00	02.12.2016	04.12.2017	34 414 084		-	100.000	100.000	04.12.	0.000	Y
3.23 % (3.2122 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	50'000.00	02.12.2016	04.12.2017	34 414 085		-	100.000	100.000	04.12.	0.000	Y
3.88 % (3.8586 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	50'000.00	02.12.2016	04.12.2017	34 414 086		-	100.000	100.000		0.000	Y
5.13 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.12.2016	05.12.2017	34 414 093		-	100.000	100.000	05.12.	0.000	Y
3.9 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	05.12.2016	05.12.2017	34 414 095		-	100.000	100.000	05.12.	0.000	Y
5.03 % Reverse Convertible auf Swisscom N	CHF	1'000.00	06.12.2016	06.12.2017	34 414 105		-	100.000	100.000	06.12.	0.000	Y
4.52 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.12.2016	06.12.2017	34 414 103		-	100.000	100.000	06.12.	0.000	Y
8.89 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.12.2016	06.12.2017	34 414 107		-	100.000	100.000	06.12.	0.000	Y
7.86 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.12.2016	06.12.2017	34 414 108		-	100.000	100.000	06.12.	0.000	Y
13.9 % (8.8254 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.05.2016	07.12.2017	30 507 199		-	100.000	100.000	07.12.	0.000	Y
11.83 % (8.0966 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.06.2016	07.12.2017	30 507 502		-	100.000	100.000	07.12.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
10.52 % (9.2371 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.10.2016	07.12.2017	32 771 794		-	100.000	100.000	07.12.	0.000	Y
11.17 % (9.8078 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.10.2016	07.12.2017	32 771 795		-	100.000	100.000	07.12.	0.000	Y
9.53 % (8.7969 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.11.2016	07.12.2017	32 771 973		-	100.000	100.000	07.12.	0.000	Y
8.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.12.2016	07.12.2017	34 414 112		-	100.000	100.000	07.12.	0.000	Y
8.33 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.12.2016	07.12.2017	34 414 111		-	100.000	100.000	07.12.	0.000	Y
5.58 % (4.9723 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.10.2016	08.12.2017	32 771 833		-	100.000	100.000	08.12.	0.000	Y
7.01 % (7.6473 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.01.2017	11.12.2017	34 414 290		-	100.000	100.000	11.12.	0.000	Y
4.32 % Reverse Convertible auf ABB N	CHF	1'000.00	12.12.2016	12.12.2017	34 414 153		-	100.000	100.000	12.12.	0.000	Y
7.17 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.12.2016	12.12.2017	34 414 148		-	100.000	100.000	12.12.	0.000	Y
3.96 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.12.2016	13.12.2017	34 414 156		-	100.000	100.000	13.12.	0.000	Y
6.11 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.12.2016	13.12.2017	34 414 162		-	100.000	100.000	13.12.	0.000	Y
4.12 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	13.12.2016	13.12.2017	34 414 157		-	100.000	100.000	13.12.	0.000	Y
4.05 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.12.2016	13.12.2017	34 414 158		-	100.000	100.000	13.12.	0.000	Y
7.02 % Reverse Convertible auf Sunrise Comm	CHF	1'000.00	14.12.2016	14.12.2017	34 414 165		-	100.000	100.000	14.12.	0.000	Y
4.64 % (4.6144 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.12.2016	18.12.2017	34 414 173		-	100.000	100.000	18.12.	0.000	Y
4.15 % (4.1271 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.12.2016	18.12.2017	34 414 175		-	100.000	100.000	18.12.	0.000	Y
3.65 % (3.6298 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.12.2016	18.12.2017	34 414 174		-	100.000	100.000	18.12.	0.000	Y
4.47 % Reverse Convertible auf Geberit N	CHF	1'000.00	19.12.2016	19.12.2017	34 414 178		-	100.000	100.000	19.12.	0.000	Y
3.56 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.12.2016	20.12.2017	34 414 188		-	100.000	100.000	20.12.	0.000	Y
5.8 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.12.2016	20.12.2017	34 414 192		-	100.000	100.000	20.12.	0.000	Y
4.19 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.12.2016	21.12.2017	34 414 198		-	100.000	100.000	21.12.	0.000	Y
7.47 % (8.4301 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.02.2017	21.12.2017	34 414 496		-	100.000	100.000	21.12.	0.000	Y
8.93 % (6.7538 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.08.2016	22.12.2017	32 771 435		-	100.000	100.000		0.000	Y
5.86 % (5.0834 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.10.2016	22.12.2017	32 771 874		-	100.000	100.000		0.000	Y
6.68 % (5.8511 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.11.2016	22.12.2017	32 771 918		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
5.06 % (4.7438 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.11.2016	22.12.2017	32 772 098		-	100.000	100.000		0.000	Y
10.07 % (9.4406 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.11.2016	22.12.2017	32 772 099		-	100.000	100.000		0.000	Y
5.83 % (5.5087 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.12.2016	22.12.2017	32 772 122		-	100.000	100.000		0.000	Y
2.52 % (2.3874 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.12.2016	22.12.2017	34 414 082		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
8.98 % (8.5751 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.12.2016	22.12.2017	34 414 101		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
10.01 % (9.5586 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.12.2016	22.12.2017	34 414 099		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
4.57 % (4.3639 % p.a.) Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	05.12.2016	22.12.2017	34 414 098		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
4.94 % (4.7172 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.12.2016	22.12.2017	34 414 097		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
7.07 % (6.7691 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.12.2016	22.12.2017	34 414 104		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
10.03 % (9.6032 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.12.2016	22.12.2017	34 414 109		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
7.06 % (6.7776 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.12.2016	22.12.2017	34 414 123		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
5.50 % (5.2941 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.12.2016	22.12.2017	34 414 137		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
3.85 % (3.7059 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.12.2016	22.12.2017	34 414 133		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
5.45 % (5.246 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	08.12.2016	22.12.2017	34 414 135		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
7.98 % (7.6813 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	08.12.2016	22.12.2017	34 414 136		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
6.35 % (6.1287 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.12.2016	22.12.2017	34 414 144		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
11.08 % (10.6938 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.12.2016	22.12.2017	34 414 141		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.00 % (4.8649 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	20'000.00	12.12.2016	22.12.2017	34 414 149		-	100.000	100.000	22.03. 22.06. 22.09. 22.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
3.91 % (3.8146 % p.a.) Reverse Convertible auf Novartis N	CHF	1'000.00	13.12.2016	22.12.2017	34 414 155		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
6.82 % (6.6717 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.12.2016	22.12.2017	34 414 166		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
6.88 % (6.7304 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.12.2016	22.12.2017	34 414 164		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
5.30 % (5.1989 % p.a.) Reverse Convertible auf ABB N	CHF	1'000.00	15.12.2016	22.12.2017	34 414 170		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
7.17 % (7.0332 % p.a.) Reverse Convertible auf Adecco Group N	CHF	1'000.00	15.12.2016	22.12.2017	34 414 171		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
7.19 % (7.1306 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.12.2016	22.12.2017	34 414 176		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
4.27 % (4.2464 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.12.2016	22.12.2017	34 414 191		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
5.35 % (5.3204 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.12.2016	22.12.2017	34 414 190		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
9.07 % (9.0449 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.12.2016	22.12.2017	34 414 199		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
6.69 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.12.2016	22.12.2017	34 414 206		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
5.45 % Reverse Convertible auf Zurich Insur Grp N	CHF	1'000.00	22.12.2016	22.12.2017	34 414 202		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
4.94 % (5.0237 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	28.12.2016	22.12.2017	34 414 236		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
7.81 % (7.9875 % p.a.) Reverse Convertible auf Adecco Group N	CHF	1'000.00	30.12.2016	22.12.2017	34 414 252		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
9.77 % (9.992 % p.a.) Reverse Convertible auf LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	30.12.2016	22.12.2017	34 414 253		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
7.63 % (8.6924 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.02.2017	22.12.2017	34 414 542		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
7.23 % (8.2892 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.02.2017	22.12.2017	34 414 566		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
8.59 % (9.8484 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.02.2017	22.12.2017	34 414 567		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
5.76 % (6.7107 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.02.2017	22.12.2017	34 414 600		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
2.28 % (3.5077 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	20'000.00	28.04.2017	22.12.2017	34 415 206		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
4.8 % (8.3883 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.05.2017	22.12.2017	34 415 405		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
3.65 % (6.4729 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.05.2017	22.12.2017	34 415 416		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
4.58 % (8.1624 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.05.2017	22.12.2017	34 415 423		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
2.6 % (5.1713 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	21.06.2017	22.12.2017	34 415 561		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
9.05 % (10.7525 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.02.2017	27.12.2017	34 414 737		-	100.000	100.000	27.12.	0.000	Y
9.67 % (9.6432 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.12.2016	28.12.2017	34 414 226		-	100.000	100.000	28.12.	0.000	Y
4.49 % (5.8778 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.03.2017	28.12.2017	34 414 965		-	100.000	100.000	28.12.	0.000	Y
2.84 % (3.9023 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.04.2017	28.12.2017	34 415 085		-	100.000	100.000	28.12.	0.000	Y
3.61 % (3.6 % p.a.) Reverse Convertible auf ABB N	CHF	1'000.00	28.12.2016	29.12.2017	34 414 238		-	100.000	100.000	29.12.	0.000	Y
9.31 % (8.0567 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.11.2016	03.01.2018	32 771 974	%	109.030	100.000	100.000		0.000	Y
6.11 % (5.6112 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.12.2016	04.01.2018	34 414 092	%	105.820	100.000	100.000		0.000	Y
3.88 % (7.2 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.06.2017	04.01.2018	34 415 554	%	103.590	100.000	100.000		0.000	Y
4.63 % (8.7267 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.06.2017	04.01.2018	36 815 767	%	103.220	100.000	100.000		0.000	Y
1.14 % (2.2426 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.07.2017	08.01.2018	36 815 844	%	100.850	100.000	100.000		0.000	Y
12.73 % (7.6508 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.05.2016	09.01.2018	30 507 200	%	112.440	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
6.23 % (4.5959 % p.a.) Reverse Convertible auf Swiss Re N	CHF	1'000.00	02.09.2016	10.01.2018	32 771 481	%	105.900	100.000	100.000		0.000	Y
6.22 % (4.5885 % p.a.) Reverse Convertible auf Swiss Re N	CHF	1'000.00	02.09.2016	10.01.2018	32 771 486	%	105.890	100.000	100.000		0.000	Y
3.37 % (3.1268 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.12.2016	10.01.2018	34 414 147	%	102.860	100.000	100.000		0.000	Y
8.55 % (7.3112 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.11.2016	12.01.2018	32 772 022	%	107.940	100.000	100.000		0.000	Y
5.91 % (5.8936 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	USD	1'000.00	11.01.2017	12.01.2018	34 414 281	%	57.660	100.000	100.000	12.07.	8.243	N
6.85 % (6.831 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	11.01.2017	12.01.2018	34 414 289	%	106.240	100.000	100.000		0.000	Y
4.55 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.01.2017	16.01.2018	34 414 310	%	103.730	100.000	100.000		0.000	Y
4.53 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.01.2017	18.01.2018	34 414 345	%	103.610	100.000	100.000		0.000	Y
4.65 % (3.4374 % p.a.) Reverse Convertible auf Novartis N	CHF	1'000.00	15.09.2016	22.01.2018	32 771 563	%	104.180	100.000	100.000		0.000	Y
4.88 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.01.2017	24.01.2018	34 414 386	%	103.910	100.000	100.000		0.000	Y
4.84 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.01.2017	24.01.2018	34 414 389	%	103.800	100.000	100.000		0.000	Y
10.11 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.01.2017	24.01.2018	34 414 383	%	109.150	100.000	100.000		0.000	Y
7.04 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.01.2017	24.01.2018	34 414 380	%	106.080	100.000	100.000		0.000	Y
5.02 % Reverse Convertible auf Orange	CHF	1'000.00	24.01.2017	24.01.2018	34 414 379	%	104.550	100.000	100.000		0.000	Y
7.14 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.01.2017	24.01.2018	34 414 385	%	106.180	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.01.2017	24.01.2018	34 414 393	%	105.040	100.000	100.000		0.000	Y
9.19 % (4.4648 % p.a.) Reverse Convertible 2015-26.01.18 auf Aktien	CHF	1'000.00	05.01.2016	26.01.2018	25 347 312	%	108.230	100.000	100.000		0.000	Y
12.2 % (5.9351 % p.a.) Reverse Convertible 2015-26.01.18 auf Aktien	CHF	1'000.00	06.01.2016	26.01.2018	25 347 319	%	111.240	100.000	100.000		0.000	Y
5.03 % (2.4942 % p.a.) Reverse Convertible auf SMI	CHF	1'000.00	20.01.2016	26.01.2018	25 347 383	%	104.570	100.000	100.000		0.000	Y
10.44 % (6.5592 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	10'000.00	23.06.2016	26.01.2018	30 507 521	%	109.480	100.000	100.000		0.000	Y
7.98 % (5.0846 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	10'000.00	01.07.2016	26.01.2018	30 507 587	%	107.020	100.000	100.000		0.000	Y
8.16 % (6.331 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.10.2016	26.01.2018	32 771 771	%	107.200	100.000	100.000		0.000	Y
3.46 % (3.0908 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.12.2016	26.01.2018	34 414 161	%	102.500	100.000	100.000		0.000	Y
9.08 % (8.3176 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	23.12.2016	26.01.2018	34 414 213	%	108.120	100.000	100.000		0.000	Y
4.10 % (3.7557 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.12.2016	26.01.2018	34 414 211	%	103.140	100.000	100.000		0.000	Y
10.77 % (9.8656 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.12.2016	26.01.2018	34 414 215	%	109.810	100.000	100.000		0.000	Y
8.58 % (7.8595 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	23.12.2016	26.01.2018	34 414 214	%	107.620	100.000	100.000		0.000	Y
2.85 % (2.6107 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.12.2016	26.01.2018	34 414 224	%	101.890	100.000	100.000		0.000	Y
3.06 % (2.8031 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.12.2016	26.01.2018	34 414 212	%	102.100	100.000	100.000		0.000	Y
6.37 % (5.8351 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.12.2016	26.01.2018	34 414 221	%	105.410	100.000	100.000		0.000	Y
6.87 % (6.2931 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.12.2016	26.01.2018	34 414 209	%	105.910	100.000	100.000		0.000	Y
9.80 % (8.9771 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.12.2016	26.01.2018	34 414 220	%	108.840	100.000	100.000		0.000	Y
4.90 % (4.4885 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.12.2016	26.01.2018	34 414 210	%	103.940	100.000	100.000		0.000	Y
3.74 % (3.426 % p.a.) Reverse Convertible auf Geberit N	CHF	1'000.00	23.12.2016	26.01.2018	34 414 217	%	103.280	100.000	100.000		0.000	Y
3.98 % (3.6833 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.12.2016	26.01.2018	34 414 230	%	103.020	100.000	100.000		0.000	Y
6.68 % (6.182 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.12.2016	26.01.2018	34 414 232	%	105.720	100.000	100.000		0.000	Y
8.68 % (8.0329 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.12.2016	26.01.2018	34 414 233	%	107.720	100.000	100.000		0.000	Y
5.59 % (5.1866 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	28.12.2016	26.01.2018	34 414 235	%	104.630	100.000	100.000		0.000	Y
3.81 % (3.5351 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.12.2016	26.01.2018	34 414 245	%	102.850	100.000	100.000		0.000	Y
5.71 % (5.2979 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	28.12.2016	26.01.2018	34 414 240	%	104.750	100.000	100.000		0.000	Y
3.65 % (3.3866 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.12.2016	26.01.2018	34 414 241	%	102.690	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
6.74 % (6.2698 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.12.2016	26.01.2018	34 414 246	%	105.780	100.000	100.000		0.000	Y
5.76 % (5.372 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.12.2016	26.01.2018	34 414 250	%	104.800	100.000	100.000		0.000	Y
7.95 % (7.4726 % p.a.) Reverse Convertible 2016-26.01.18 auf Aktien	EUR	1'000.00	03.01.2017	26.01.2018	34 414 259	%	102.750	100.000	100.000	26.07.	0.000	N
5.67 % (5.3575 % p.a.) Reverse Convertible 2016-26.01.18 auf Aktien	CHF	1'000.00	05.01.2017	26.01.2018	34 414 263	%	104.710	100.000	100.000		0.000	Y
5.52 % (5.2711 % p.a.) Reverse Convertible 2016-26.01.18 auf Aktien	CHF	1'000.00	09.01.2017	26.01.2018	34 414 265	%	60.190	100.000	100.000		0.000	Y
8.21 % (7.8606 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	10.01.2017	26.01.2018	34 414 270	%	107.250	100.000	100.000		0.000	Y
4.00 % (3.8298 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	10.01.2017	26.01.2018	34 414 273	%	103.040	100.000	100.000		0.000	Y
5.76 % (5.5296 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	11.01.2017	26.01.2018	34 414 284	%	104.800	100.000	100.000		0.000	Y
5.29 % (5.0784 % p.a.) Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	11.01.2017	26.01.2018	34 414 288	%	104.830	100.000	100.000		0.000	Y
3.65 % (3.504 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.01.2017	26.01.2018	34 414 278	%	102.690	100.000	100.000		0.000	Y
4.85 % (4.656 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	11.01.2017	26.01.2018	34 414 277	%	103.890	100.000	100.000		0.000	Y
7.66 % (7.3733 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.01.2017	26.01.2018	34 414 298	%	106.700	100.000	100.000		0.000	Y
8.52 % (8.2011 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.01.2017	26.01.2018	34 414 297	%	107.560	100.000	100.000		0.000	Y
5.12 % (4.9283 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.01.2017	26.01.2018	34 414 291	%	104.160	100.000	100.000		0.000	Y
7.60 % (7.3351 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.01.2017	26.01.2018	34 414 304	%	106.640	100.000	100.000		0.000	Y
6.29 % (6.0708 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.01.2017	26.01.2018	34 414 301	%	105.330	100.000	100.000		0.000	Y
5.92 % (5.7756 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.01.2017	26.01.2018	34 414 331	%	104.960	100.000	100.000		0.000	Y
4.70 % (4.5854 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.01.2017	26.01.2018	34 414 333	%	103.740	100.000	100.000		0.000	Y
3.19 % (3.1122 % p.a.) Reverse Convertible auf Geberit N	CHF	1'000.00	17.01.2017	26.01.2018	34 414 332	%	102.730	100.000	100.000		0.000	Y
6.71 % (6.5463 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.01.2017	26.01.2018	34 414 334	%	105.750	100.000	100.000		0.000	Y
5.70 % (5.5761 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.01.2017	26.01.2018	34 414 344	%	104.740	100.000	100.000		0.000	Y
7.08 % (6.945 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.01.2017	26.01.2018	34 414 364	%	106.120	100.000	100.000		0.000	Y
4.67 % (4.5809 % p.a.) Reverse Convertible auf CS Group N	CHF	1'000.00	19.01.2017	26.01.2018	34 414 362	%	104.210	100.000	100.000		0.000	Y
3.86 % (3.7864 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.01.2017	26.01.2018	34 414 360	%	102.900	100.000	100.000		0.000	Y
10.20 % (10.0054 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.01.2017	26.01.2018	34 414 358	%	109.240	100.000	100.000		0.000	Y
4.77 % (4.679 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.01.2017	26.01.2018	34 414 351	%	103.810	100.000	100.000		0.000	Y
3.27 % (3.2076 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.01.2017	26.01.2018	34 414 361	%	102.310	100.000	100.000		0.000	Y
5.46 % (5.3559 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.01.2017	26.01.2018	34 414 350	%	104.500	100.000	100.000		0.000	Y
3.16 % (3.1082 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.01.2017	26.01.2018	34 414 367	%	102.200	100.000	100.000		0.000	Y
11.01 % (10.919 % p.a.) Reverse Convertible auf CS Group N	CHF	1'000.00	23.01.2017	26.01.2018	34 414 371	%	110.550	100.000	100.000		0.000	Y
9.61 % (9.5306 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.01.2017	26.01.2018	34 414 369	%	108.650	100.000	100.000		0.000	Y
4.34 % (4.3041 % p.a.) Reverse Convertible auf Novartis N	CHF	1'000.00	23.01.2017	26.01.2018	34 414 370	%	103.880	100.000	100.000		0.000	Y
6.23 % (6.1956 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.01.2017	26.01.2018	34 414 395	%	105.370	100.000	100.000		0.000	Y
6.2 % (6.1657 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.01.2017	26.01.2018	34 414 396	%	105.240	100.000	100.000		0.000	Y
5.9 % (5.8674 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.01.2017	26.01.2018	34 414 394	%	104.940	100.000	100.000		0.000	Y
1.89 % (1.8796 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	24.01.2017	26.01.2018	34 414 392	%	100.930	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
1.42 % (1.4122 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.01.2017	26.01.2018	34 414 391	%	100.460	100.000	100.000		0.000	Y
9.78 % (9.726 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.01.2017	26.01.2018	34 414 387	%	108.820	100.000	100.000		0.000	Y
3.28 % (3.2619 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.01.2017	26.01.2018	34 414 382	%	102.320	100.000	100.000		0.000	Y
4.73 % (4.7039 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	24.01.2017	26.01.2018	34 414 377	%	103.770	100.000	100.000		0.000	Y
5.39 % (5.3602 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.01.2017	26.01.2018	34 414 381	%	104.430	100.000	100.000		0.000	Y
4.26 % (4.2365 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.01.2017	26.01.2018	34 414 375	%	103.300	100.000	100.000		0.000	Y
5.12 % (5.0917 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.01.2017	26.01.2018	34 414 374	%	104.160	100.000	100.000		0.000	Y
4.49 % (4.4652 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.01.2017	26.01.2018	34 414 373	%	103.530	100.000	100.000		0.000	Y
7.03 % (6.9912 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.01.2017	26.01.2018	34 414 397	%	106.070	100.000	100.000		0.000	Y
3.61 % (3.5901 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.01.2017	26.01.2018	34 414 376	%	102.650	100.000	100.000		0.000	Y
10.52 % (10.4909 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.01.2017	26.01.2018	34 414 409	%	109.560	100.000	100.000		0.000	Y
7.74 % (7.7186 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.01.2017	26.01.2018	34 414 408	%	106.780	100.000	100.000		0.000	Y
6.42 % (6.4022 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.01.2017	26.01.2018	34 414 399	%	105.460	100.000	100.000		0.000	Y
3.25 % (3.241 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.01.2017	26.01.2018	34 414 401	%	102.290	100.000	100.000		0.000	Y
5.6 % (5.5845 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.01.2017	26.01.2018	34 414 404	%	104.640	100.000	100.000		0.000	Y
7.99 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.01.2017	26.01.2018	34 414 415	%	107.030	100.000	100.000		0.000	Y
5.08 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.01.2017	26.01.2018	34 414 416	%	104.120	100.000	100.000		0.000	Y
2.86 % Reverse Convertible auf Kuehne +Nagel Int N	CHF	1'000.00	26.01.2017	26.01.2018	34 414 428	%	102.400	100.000	100.000		0.000	Y
4.79 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	26.01.2017	26.01.2018	34 414 413	%	103.830	100.000	100.000		0.000	Y
3.7 % Reverse Convertible auf Sonova Hldg N	CHF	1'000.00	26.01.2017	26.01.2018	34 414 427	%	103.240	100.000	100.000		0.000	Y
4.25 % Reverse Convertible auf Panalpina Welttra N	CHF	1'000.00	26.01.2017	26.01.2018	34 414 426	%	103.790	100.000	100.000		0.000	Y
4.75 % Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	1'000.00	26.01.2017	26.01.2018	34 414 425	%	104.290	100.000	100.000		0.000	Y
3.82 % Reverse Convertible auf Geberit N	CHF	1'000.00	26.01.2017	26.01.2018	34 414 424	%	103.360	100.000	100.000		0.000	Y
4.75 % Reverse Convertible auf LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	26.01.2017	26.01.2018	34 414 421	%	104.400	100.000	100.000		0.000	Y
7.5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.01.2017	26.01.2018	34 414 418	%	106.540	100.000	100.000		0.000	Y
6 % (6.0167 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.01.2017	26.01.2018	34 414 437	%	105.040	100.000	100.000		0.000	Y
8.34 % (9.7165 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	17.03.2017	26.01.2018	34 414 944	%	107.380	100.000	100.000		0.000	Y
9.47 % (11.2887 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	24.03.2017	26.01.2018	34 414 973	%	108.510	100.000	100.000		0.000	Y
6.29 % (10.9922 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.06.2017	26.01.2018	36 815 814	%	105.020	100.000	100.000		0.000	Y
3.87 % (7.001 % p.a.) Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	1'000.00	07.07.2017	26.01.2018	36 815 853	%	103.410	100.000	100.000		0.000	Y
10.5 % (19.3846 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.07.2017	26.01.2018	36 815 865	%	109.540	100.000	100.000		0.000	Y
5.49 % (10.2404 % p.a.) Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	1'000.00	13.07.2017	26.01.2018	36 815 878	%	104.860	100.000	100.000		0.000	Y
2.84 % (5.4674 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.07.2017	26.01.2018	36 815 899	%	101.880	100.000	100.000		0.000	Y
2.38 % (4.7337 % p.a.) Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	1'000.00	25.07.2017	26.01.2018	36 815 917	%	101.920	100.000	100.000		0.000	Y
3.22 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	30.01.2017	30.01.2018	34 414 444	%	102.270	100.000	100.000		0.000	Y
4.05 % Reverse Convertible auf ABB N	CHF	1'000.00	30.01.2017	30.01.2018	34 414 445	%	103.600	100.000	100.000		0.000	Y
8.56 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	30.01.2017	30.01.2018	34 414 457	%	107.610	100.000	100.000		0.000	Y
3.55 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.01.2017	31.01.2018	34 414 463	%	102.600	100.000	100.000		0.000	Y
4.83 % (3.8554 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.10.2016	01.02.2018	32 771 900	%	103.880	100.000	100.000		0.000	Y
8.71 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.02.2017	01.02.2018	34 414 476	%	107.760	100.000	100.000		0.000	Y
8.53 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.02.2017	01.02.2018	34 414 474	%	107.580	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
8.55 % Reverse Convertible auf Fiat Chrysler Auto	CHF	1'000.00	01.02.2017	01.02.2018	34 414 490	%	108.210	100.000	100.000		0.000	Y
10.32 % (8.3865 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.11.2016	02.02.2018	32 771 993	%	109.380	100.000	100.000		0.000	Y
6.13 % (5.5868 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.12.2016	02.02.2018	34 414 231	%	105.180	100.000	100.000		0.000	Y
7.4 % (7.3591 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.02.2017	05.02.2018	34 414 525	%	106.460	100.000	100.000		0.000	Y
3.26 % (3.242 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.02.2017	05.02.2018	34 414 527	%	102.320	100.000	100.000		0.000	Y
6.77 % Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	1'000.00	06.02.2017	06.02.2018	34 414 539	%	106.410	100.000	100.000		0.000	Y
6.2 % Reverse Convertible auf ARYZTA N	CHF	1'000.00	08.02.2017	08.02.2018	34 414 563	%	105.770	100.000	100.000		0.000	Y
9.6 % (7.7143 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.11.2016	09.02.2018	32 772 021	%	108.670	100.000	100.000		0.000	Y
5.79 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.02.2017	09.02.2018	34 414 585	%	104.850	100.000	100.000		0.000	Y
5.65 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.02.2017	09.02.2018	34 414 576	%	104.710	100.000	100.000		0.000	Y
3.99 % (3.6643 % p.a.) Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	10.01.2017	12.02.2018	34 414 272	%	103.060	100.000	100.000		0.000	Y
4.94 % (4.9127 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	10.02.2017	12.02.2018	34 414 592	%	104.010	100.000	100.000		0.000	Y
6.08 % (6.0464 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	10.02.2017	12.02.2018	34 414 597	%	105.150	100.000	100.000		0.000	Y
3.83 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.02.2017	15.02.2018	34 414 627	%	102.900	100.000	100.000		0.000	Y
4.04 % (4.0513 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.02.2017	16.02.2018	34 414 659	%	103.120	100.000	100.000		0.000	Y
6.9 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	22.02.2017	22.02.2018	34 414 705	%	105.990	100.000	100.000		0.000	Y
6.12 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	22.02.2017	22.02.2018	34 414 706	%	105.210	100.000	100.000		0.000	Y
5.06 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.02.2017	22.02.2018	34 414 707	%	104.150	100.000	100.000		0.000	Y
5.13 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	22.02.2017	22.02.2018	34 414 714	%	104.220	100.000	100.000		0.000	Y
6.3 % Reverse Convertible auf LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	22.02.2017	22.02.2018	34 414 712	%	105.830	100.000	100.000		0.000	Y
6.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	22.02.2017	22.02.2018	34 414 713	%	105.290	100.000	100.000		0.000	Y
5.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.02.2017	22.02.2018	34 414 711	%	104.290	100.000	100.000		0.000	Y
13.09 % (6.3767 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	04.02.2016	23.02.2018	30 506 702	%	112.190	100.000	100.000		0.000	Y
9.52 % (4.6439 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.02.2016	23.02.2018	30 506 720	%	108.620	100.000	100.000		0.000	Y
17.39 % (8.6231 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.02.2016	23.02.2018	30 506 773	%	116.490	100.000	100.000		0.000	Y
9.87 % (6.5678 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.08.2016	23.02.2018	32 771 408	%	108.970	100.000	100.000		0.000	Y
9.8 % (6.5333 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	23.08.2016	23.02.2018	32 771 415	%	108.830	100.000	100.000		0.000	Y
6.76 % (5.5059 % p.a.) Reverse Convertible auf CS Group N	CHF	1'000.00	01.12.2016	23.02.2018	34 414 078	%	106.460	100.000	100.000		0.000	Y
3.75 % (3.4974 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.01.2017	23.02.2018	34 414 432	%	102.840	100.000	100.000		0.000	Y
5.48 % (5.1109 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.01.2017	23.02.2018	34 414 431	%	104.570	100.000	100.000		0.000	Y
7.63 % (7.1718 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	30.01.2017	23.02.2018	34 414 447	%	106.720	100.000	100.000		0.000	Y
6.44 % (6.0533 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.01.2017	23.02.2018	34 414 452	%	105.530	100.000	100.000		0.000	Y
6.3 % (5.9217 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.01.2017	23.02.2018	34 414 446	%	105.390	100.000	100.000		0.000	Y
7.25 % (6.8146 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	30.01.2017	23.02.2018	34 414 451	%	106.330	100.000	100.000		0.000	Y
8.36 % (7.858 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.01.2017	23.02.2018	34 414 450	%	107.450	100.000	100.000		0.000	Y
7.59 % (7.1342 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	31.01.2017	23.02.2018	34 414 459	%	106.680	100.000	100.000		0.000	Y
7.59 % (7.1342 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	31.01.2017	23.02.2018	34 414 464	%	106.680	100.000	100.000		0.000	Y
6.8 % (6.3916 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.01.2017	23.02.2018	34 414 466	%	105.890	100.000	100.000		0.000	Y
8.94 % (8.4031 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	31.01.2017	23.02.2018	34 414 465	%	108.040	100.000	100.000		0.000	Y
7.42 % (6.9744 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	31.01.2017	23.02.2018	34 414 458	%	106.510	100.000	100.000		0.000	Y
9.75 % (9.1645 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.01.2017	23.02.2018	34 414 471	%	108.880	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.97 % (5.6115 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	31.01.2017	23.02.2018	34 414 461	%	105.060	100.000	100.000		0.000	Y
3.41 % (3.2136 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.02.2017	23.02.2018	34 414 486	%	102.500	100.000	100.000		0.000	Y
9.91 % (9.3393 % p.a.) Reverse Convertible auf CS Group N	CHF	1'000.00	01.02.2017	23.02.2018	34 414 485	%	109.500	100.000	100.000		0.000	Y
5.62 % (5.2963 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.02.2017	23.02.2018	34 414 479	%	104.710	100.000	100.000		0.000	Y
6.3 % (5.9372 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.02.2017	23.02.2018	34 414 477	%	105.390	100.000	100.000		0.000	Y
6.69 % (6.3047 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.02.2017	23.02.2018	34 414 480	%	105.780	100.000	100.000		0.000	Y
6.15 % (5.7958 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.02.2017	23.02.2018	34 414 475	%	105.230	100.000	100.000		0.000	Y
5.12 % (4.8378 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	02.02.2017	23.02.2018	34 414 503	%	104.210	100.000	100.000		0.000	Y
9.23 % (8.7213 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	02.02.2017	23.02.2018	34 414 491	%	108.330	100.000	100.000		0.000	Y
5.46 % (5.1591 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.02.2017	23.02.2018	34 414 492	%	104.550	100.000	100.000		0.000	Y
7.39 % (6.9827 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.02.2017	23.02.2018	34 414 495	%	106.480	100.000	100.000		0.000	Y
6.84 % (6.463 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.02.2017	23.02.2018	34 414 494	%	105.930	100.000	100.000		0.000	Y
7.21 % (6.8126 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.02.2017	23.02.2018	34 414 512	%	106.300	100.000	100.000		0.000	Y
4.16 % (3.9307 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.02.2017	23.02.2018	34 414 505	%	103.250	100.000	100.000		0.000	Y
8.03 % (7.5874 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.02.2017	23.02.2018	34 414 509	%	107.120	100.000	100.000		0.000	Y
5.41 % (5.1118 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.02.2017	23.02.2018	34 414 500	%	104.500	100.000	100.000		0.000	Y
3.8 % (3.5906 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.02.2017	23.02.2018	34 414 497	%	102.890	100.000	100.000		0.000	Y
6.07 % (5.7354 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.02.2017	23.02.2018	34 414 498	%	105.160	100.000	100.000		0.000	Y
4.61 % (4.3674 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.02.2017	23.02.2018	34 414 523	%	103.700	100.000	100.000		0.000	Y
7.73 % (7.3232 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.02.2017	23.02.2018	34 414 526	%	106.820	100.000	100.000		0.000	Y
5.96 % (5.6912 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.02.2017	23.02.2018	34 414 537	%	105.050	100.000	100.000		0.000	Y
4.95 % (4.7268 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.02.2017	23.02.2018	34 414 535	%	104.040	100.000	100.000		0.000	Y
7.92 % (7.5629 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.02.2017	23.02.2018	34 414 541	%	107.010	100.000	100.000		0.000	Y
6.88 % (6.5872 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.02.2017	23.02.2018	34 414 544	%	105.970	100.000	100.000		0.000	Y
3.85 % (3.6862 % p.a.) Reverse Convertible auf Sonova Hldg N	CHF	1'000.00	07.02.2017	23.02.2018	34 414 558	%	103.440	100.000	100.000		0.000	Y
7.79 % (7.4585 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.02.2017	23.02.2018	34 414 556	%	106.880	100.000	100.000		0.000	Y
6.86 % (6.5681 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.02.2017	23.02.2018	34 414 553	%	105.950	100.000	100.000		0.000	Y
6.77 % (6.4819 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.02.2017	23.02.2018	34 414 552	%	105.860	100.000	100.000		0.000	Y
8.06 % (7.717 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	07.02.2017	23.02.2018	34 414 551	%	107.160	100.000	100.000		0.000	Y
9.88 % (9.4848 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	08.02.2017	23.02.2018	34 414 572	%	108.970	100.000	100.000		0.000	Y
7.65 % (7.344 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.02.2017	23.02.2018	34 414 562	%	106.810	100.000	100.000		0.000	Y
4.71 % (4.5216 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.02.2017	23.02.2018	34 414 565	%	103.800	100.000	100.000		0.000	Y
3.81 % (3.6576 % p.a.) Reverse Convertible auf Sonova Hldg N	CHF	1'000.00	08.02.2017	23.02.2018	34 414 561	%	103.400	100.000	100.000		0.000	Y
6.82 % (6.5472 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	08.02.2017	23.02.2018	34 414 564	%	105.910	100.000	100.000		0.000	Y
8.84 % (8.5091 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	09.02.2017	23.02.2018	34 414 577	%	107.940	100.000	100.000		0.000	Y
4.11 % (3.9561 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.02.2017	23.02.2018	34 414 575	%	103.200	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4.21 % (4.0524 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.02.2017	23.02.2018	34 414 574	%	103.300	100.000	100.000		0.000	Y
7.01 % (6.7476 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	09.02.2017	23.02.2018	34 414 584	%	106.100	100.000	100.000		0.000	Y
2.19 % (2.1137 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.02.2017	23.02.2018	34 414 595	%	101.280	100.000	100.000		0.000	Y
9.16 % (8.8408 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	10.02.2017	23.02.2018	34 414 593	%	108.260	100.000	100.000		0.000	Y
5.45 % (5.2601 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.02.2017	23.02.2018	34 414 598	%	104.540	100.000	100.000		0.000	Y
6.7 % (6.5189 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	13.02.2017	23.02.2018	34 414 605	%	105.790	100.000	100.000		0.000	Y
5.09 % (4.9524 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.02.2017	23.02.2018	34 414 601	%	104.180	100.000	100.000		0.000	Y
10.44 % (10.1854 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	14.02.2017	23.02.2018	34 414 614	%	109.540	100.000	100.000		0.000	Y
6.77 % (6.6049 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.02.2017	23.02.2018	34 414 618	%	105.860	100.000	100.000		0.000	Y
7.19 % (7.0146 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	14.02.2017	23.02.2018	34 414 610	%	106.280	100.000	100.000		0.000	Y
7.65 % (7.4634 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.02.2017	23.02.2018	34 414 611	%	106.740	100.000	100.000		0.000	Y
7 % (6.8478 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.02.2017	23.02.2018	34 414 632	%	106.090	100.000	100.000		0.000	Y
5.37 % (5.2533 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.02.2017	23.02.2018	34 414 631	%	104.460	100.000	100.000		0.000	Y
3.46 % (3.3848 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.02.2017	23.02.2018	34 414 630	%	102.550	100.000	100.000		0.000	Y
4.54 % (4.4413 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.02.2017	23.02.2018	34 414 628	%	103.630	100.000	100.000		0.000	Y
2.99 % (2.933 % p.a.) Reverse Convertible auf Galenica N	CHF	1'000.00	16.02.2017	23.02.2018	34 414 639	%	102.570	100.000	100.000		0.000	Y
13.23 % (12.9777 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.02.2017	23.02.2018	34 414 642	%	112.310	100.000	100.000		0.000	Y
7.74 % (7.5924 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.02.2017	23.02.2018	34 414 637	%	106.830	100.000	100.000		0.000	Y
3.64 % (3.5706 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.02.2017	23.02.2018	34 414 645	%	102.730	100.000	100.000		0.000	Y
4.73 % (4.6398 % p.a.) Reverse Convertible auf Geberit N	CHF	1'000.00	16.02.2017	23.02.2018	34 414 638	%	104.250	100.000	100.000		0.000	Y
5.67 % (5.577 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.02.2017	23.02.2018	34 414 652	%	104.760	100.000	100.000		0.000	Y
5.36 % (5.2721 % p.a.) Reverse Convertible auf Cie Financiere Richemont	CHF	1'000.00	17.02.2017	23.02.2018	34 414 653	%	104.950	100.000	100.000		0.000	Y
6.06 % (5.9607 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	17.02.2017	23.02.2018	34 414 663	%	105.150	100.000	100.000		0.000	Y
6.85 % (6.7377 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	17.02.2017	23.02.2018	34 414 662	%	105.940	100.000	100.000		0.000	Y
6.42 % (6.3148 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	17.02.2017	23.02.2018	34 414 661	%	105.510	100.000	100.000		0.000	Y
5.24 % (5.1541 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.02.2017	23.02.2018	34 414 656	%	104.330	100.000	100.000		0.000	Y
3.74 % (3.7091 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.02.2017	23.02.2018	34 414 674	%	102.830	100.000	100.000		0.000	Y
3.93 % (3.8975 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.02.2017	23.02.2018	34 414 683	%	103.020	100.000	100.000		0.000	Y
6.37 % (6.3174 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.02.2017	23.02.2018	34 414 681	%	105.460	100.000	100.000		0.000	Y
7.09 % (7.0314 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	20.02.2017	23.02.2018	34 414 680	%	106.180	100.000	100.000		0.000	Y
3.37 % (3.3421 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.02.2017	23.02.2018	34 414 679	%	102.460	100.000	100.000		0.000	Y
4.52 % (4.4826 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	20.02.2017	23.02.2018	34 414 678	%	103.610	100.000	100.000		0.000	Y
2.58 % (2.5587 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.02.2017	23.02.2018	34 414 672	%	101.670	100.000	100.000		0.000	Y
5.05 % (5.0083 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.02.2017	23.02.2018	34 414 673	%	104.140	100.000	100.000		0.000	Y
6.02 % (5.9867 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.02.2017	23.02.2018	34 414 693	%	105.110	100.000	100.000		0.000	Y
5.48 % (5.4497 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	21.02.2017	23.02.2018	34 414 692	%	104.570	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.6 % (5.5691 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	21.02.2017	23.02.2018	34 414 690	%	104.690	100.000	100.000		0.000	Y
6.34 % (6.305 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	21.02.2017	23.02.2018	34 414 689	%	105.430	100.000	100.000		0.000	Y
6.05 % (6.0166 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.02.2017	23.02.2018	34 414 688	%	105.140	100.000	100.000		0.000	Y
6.12 % (6.0862 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.02.2017	23.02.2018	34 414 701	%	105.210	100.000	100.000		0.000	Y
5.76 % (5.7282 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.02.2017	23.02.2018	34 414 700	%	104.840	100.000	100.000		0.000	Y
10.46 % (10.4022 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.02.2017	23.02.2018	34 414 699	%	109.560	100.000	100.000		0.000	Y
10.76 % (10.7006 % p.a.) Reverse Convertible auf CS Group N	CHF	1'000.00	21.02.2017	23.02.2018	34 414 695	%	110.350	100.000	100.000		0.000	Y
5.47 % (5.4398 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.02.2017	23.02.2018	34 414 694	%	104.490	100.000	100.000		0.000	Y
5.38 % (5.3651 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.02.2017	23.02.2018	34 414 709	%	104.470	100.000	100.000		0.000	Y
4.23 % (4.2183 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.02.2017	23.02.2018	34 414 708	%	103.320	100.000	100.000		0.000	Y
5.92 % (5.9036 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.02.2017	23.02.2018	34 414 702	%	105.000	100.000	100.000		0.000	Y
5.59 % (5.5745 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.02.2017	23.02.2018	34 414 715	%	104.680	100.000	100.000		0.000	Y
5.28 % (5.2654 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.02.2017	23.02.2018	34 414 710	%	104.370	100.000	100.000		0.000	Y
6.35 % (6.3324 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	22.02.2017	23.02.2018	34 414 704	%	105.440	100.000	100.000		0.000	Y
4.41 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	23.02.2017	23.02.2018	34 414 724	%	103.500	100.000	100.000		0.000	Y
3.91 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.02.2017	23.02.2018	34 414 720	%	103.000	100.000	100.000		0.000	Y
7.09 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.02.2017	23.02.2018	34 414 725	%	106.180	100.000	100.000		0.000	Y
5.9 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.02.2017	23.02.2018	34 414 721	%	104.990	100.000	100.000		0.000	Y
3.69 % (3.7003 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.02.2017	23.02.2018	34 414 733	%	102.770	100.000	100.000		0.000	Y
3.47 % (3.4797 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.02.2017	23.02.2018	34 414 734	%	102.560	100.000	100.000		0.000	Y
5.2 % (5.3333 % p.a.) Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	02.03.2017	23.02.2018	34 414 804	%	104.590	100.000	100.000		0.000	Y
4.12 % (4.2867 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	07.03.2017	23.02.2018	34 414 850	%	103.210	100.000	100.000		0.000	Y
4.09 % (4.9912 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.04.2017	23.02.2018	34 415 210	%	103.180	100.000	100.000		0.000	Y
2.98 % (3.8178 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.05.2017	23.02.2018	34 415 318	%	102.070	100.000	100.000		0.000	Y
5.23 % (6.9733 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.05.2017	23.02.2018	34 415 379	%	104.240	100.000	100.000		0.000	Y
4.94 % (9.2145 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.08.2017	23.02.2018	36 815 976	%	103.880	100.000	100.000		0.000	Y
4.36 % (8.175 % p.a.) Reverse Convertible auf ams I	CHF	1'000.00	11.08.2017	23.02.2018	36 815 982	%	103.470	100.000	100.000		0.000	Y
2.76 % (5.3419 % p.a.) Reverse Convertible auf Vifor Pharma N	CHF	1'000.00	17.08.2017	23.02.2018	36 816 023	%	102.340	100.000	100.000		0.000	Y
9.96 % (9.2891 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.01.2017	26.02.2018	34 414 460	%	109.060	100.000	100.000		0.000	Y
4.18 % (4.1569 % p.a.) Reverse Convertible auf LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	24.02.2017	26.02.2018	34 414 745	%	103.780	100.000	100.000		0.000	Y
6.32 % (6.2851 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.02.2017	26.02.2018	34 414 747	%	105.380	100.000	100.000		0.000	Y
8.06 % (8.0155 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	24.02.2017	26.02.2018	34 414 746	%	106.770	100.000	100.000		0.000	Y
4.08 % (4.0575 % p.a.) Reverse Convertible auf Carrefour P	CHF	1'000.00	24.02.2017	26.02.2018	34 414 743	%	99.530	100.000	100.000		0.000	Y
6.63 % (6.5934 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	24.02.2017	26.02.2018	34 414 742	%	105.730	100.000	100.000		0.000	Y
5.01 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.02.2017	27.02.2018	34 414 754	%	104.110	100.000	100.000		0.000	Y
4.61 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	01.03.2017	01.03.2018	34 414 770	%	101.340	100.000	100.000	01.09.	0.000	N
3.89 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.03.2017	01.03.2018	34 414 774	%	102.990	100.000	100.000		0.000	Y
8.11 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.03.2017	01.03.2018	34 414 781	%	107.210	100.000	100.000		0.000	Y
6.53 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.03.2017	01.03.2018	34 414 783	%	105.640	100.000	100.000		0.000	Y
5.75 % (5.766 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.03.2017	01.03.2018	34 414 792	%	104.850	100.000	100.000		0.000	Y
5.81 % (5.8262 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.03.2017	01.03.2018	34 414 791	%	104.910	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
7.09 % (7.1097 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.03.2017	01.03.2018	34 414 790	%	106.200	100.000	100.000		0.000	Y
6.47 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.03.2017	02.03.2018	34 414 789	%	105.570	100.000	100.000		0.000	Y
4.03 % (3.9857 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.03.2017	05.03.2018	34 414 777	%	103.130	100.000	100.000		0.000	Y
3.73 % (3.689 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.03.2017	05.03.2018	34 414 776	%	102.830	100.000	100.000		0.000	Y
7.36 % (7.2992 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.03.2017	05.03.2018	34 414 806	%	106.470	100.000	100.000		0.000	Y
6 % (5.9669 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.03.2017	05.03.2018	34 414 822	%	105.110	100.000	100.000		0.000	Y
5.23 % (5.2011 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.03.2017	05.03.2018	34 414 826	%	104.340	100.000	100.000		0.000	Y
5.63 % (5.5989 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.03.2017	05.03.2018	34 414 831	%	64.000	100.000	100.000		0.000	Y
7.35 % (7.3094 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.03.2017	05.03.2018	34 414 821	%	106.460	100.000	100.000		0.000	Y
5.07 % (5.042 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.03.2017	05.03.2018	34 414 828	%	104.180	100.000	100.000		0.000	Y
4.93 % (4.9028 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.03.2017	05.03.2018	34 414 817	%	104.040	100.000	100.000		0.000	Y
6.12 % (6.0862 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.03.2017	05.03.2018	34 414 819	%	105.190	100.000	100.000		0.000	Y
5.56 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.03.2017	07.03.2018	34 414 853	%	104.670	100.000	100.000		0.000	Y
3.63 % (3.5224 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.02.2017	08.03.2018	34 414 756	%	102.740	100.000	100.000		0.000	Y
3.34 % (3.3215 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.03.2017	08.03.2018	34 414 832	%	102.450	100.000	100.000		0.000	Y
2.68 % (2.6875 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.03.2017	12.03.2018	34 414 897	%	101.790	100.000	100.000		0.000	Y
7.13 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.03.2017	13.03.2018	34 414 886	%	106.250	100.000	100.000		0.000	Y
5.91 % (5.8936 % p.a.) Reverse Convertible auf u-blox Hldg N	CHF	1'000.00	14.03.2017	15.03.2018	34 414 904	%	105.450	100.000	100.000		0.000	Y
5.38 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	15.03.2017	15.03.2018	34 414 907	%	104.480	100.000	100.000		0.000	Y
11.13 % (10.9177 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.03.2017	16.03.2018	34 414 871	%	110.270	100.000	100.000		0.000	Y
10.69 % (10.4861 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.03.2017	16.03.2018	34 414 872	%	108.540	100.000	100.000		0.000	Y
4.49 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.03.2017	16.03.2018	34 414 928	%	103.720	100.000	100.000		0.000	Y
8.39 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.03.2017	16.03.2018	34 414 922	%	107.520	100.000	100.000		0.000	Y
5.52 % (4.6979 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.01.2017	19.03.2018	34 414 309	%	104.560	100.000	100.000		0.000	Y
5.08 % (4.9161 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.03.2017	19.03.2018	34 414 846	%	104.190	100.000	100.000		0.000	Y
5.87 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.03.2017	21.03.2018	34 414 956	%	105.000	100.000	100.000		0.000	Y
2.93 % (2.6569 % p.a.) Reverse Convertible auf Inditex	CHF	1'000.00	16.02.2017	23.03.2018	34 414 640	%	102.150	100.000	100.000		0.000	Y
4.87 % (4.5069 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.02.2017	23.03.2018	34 414 739	%	103.900	100.000	100.000		0.000	Y
2.36 % (2.1841 % p.a.) Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	24.02.2017	23.03.2018	34 414 738	%	101.960	100.000	100.000		0.000	Y
6.12 % (5.6638 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.02.2017	23.03.2018	34 414 740	%	105.230	100.000	100.000		0.000	Y
3.21 % (2.9707 % p.a.) Reverse Convertible auf Total	CHF	1'000.00	24.02.2017	23.03.2018	34 414 744	%	102.840	100.000	100.000		0.000	Y
7.64 % (7.0704 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.02.2017	23.03.2018	34 414 735	%	106.710	100.000	100.000		0.000	Y
4.46 % (4.1275 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.02.2017	23.03.2018	34 414 736	%	103.560	100.000	100.000		0.000	Y
5 % (4.6632 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.02.2017	23.03.2018	34 414 761	%	104.000	100.000	100.000		0.000	Y
10.52 % (9.8114 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.02.2017	23.03.2018	34 414 762	%	109.610	100.000	100.000		0.000	Y
5.97 % (5.5679 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.02.2017	23.03.2018	34 414 760	%	105.080	100.000	100.000		0.000	Y
8.44 % (7.8715 % p.a.) Reverse Convertible auf CS Group N	CHF	1'000.00	27.02.2017	23.03.2018	34 414 755	%	108.060	100.000	100.000		0.000	Y
3.07 % (2.8856 % p.a.) Reverse Convertible auf UBS Group N	CHF	1'000.00	28.02.2017	23.03.2018	34 414 765	%	102.710	100.000	100.000		0.000	Y
7.91 % (7.435 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.02.2017	23.03.2018	34 414 768	%	106.840	100.000	100.000		0.000	Y
7.12 % (6.7099 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.03.2017	23.03.2018	34 414 786	%	106.160	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.98 % (5.6356 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.03.2017	23.03.2018	34 414 780	%	105.120	100.000	100.000		0.000	Y
5.75 % (5.4188 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.03.2017	23.03.2018	34 414 782	%	104.860	100.000	100.000		0.000	Y
8.15 % (7.6806 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	01.03.2017	23.03.2018	34 414 785	%	107.250	100.000	100.000		0.000	Y
6 % (5.6545 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	01.03.2017	23.03.2018	34 414 773	%	105.130	100.000	100.000		0.000	Y
7.8 % (7.3508 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.03.2017	23.03.2018	34 414 769	%	106.930	100.000	100.000		0.000	Y
4.25 % (4.0052 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	01.03.2017	23.03.2018	34 414 779	%	103.380	100.000	100.000		0.000	Y
6.67 % (6.3024 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.03.2017	23.03.2018	34 414 800	%	105.810	100.000	100.000		0.000	Y
5.87 % (5.5465 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.03.2017	23.03.2018	34 414 793	%	104.880	100.000	100.000		0.000	Y
5.75 % (5.4331 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.03.2017	23.03.2018	34 414 809	%	104.470	100.000	100.000		0.000	Y
6.29 % (5.9433 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	02.03.2017	23.03.2018	34 414 797	%	105.200	100.000	100.000		0.000	Y
5.25 % (4.9606 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.03.2017	23.03.2018	34 414 796	%	104.330	100.000	100.000		0.000	Y
4.75 % (4.4882 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.03.2017	23.03.2018	34 414 807	%	103.720	100.000	100.000		0.000	Y
7.56 % (7.1433 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.03.2017	23.03.2018	34 414 802	%	106.250	100.000	100.000		0.000	Y
3.73 % (3.5337 % p.a.) Reverse Convertible auf Microsoft Rg	EUR	1'000.00	03.03.2017	23.03.2018	34 414 811	%	101.310	100.000	100.000	23.09.	0.000	N
5.84 % (5.5326 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.03.2017	23.03.2018	34 414 820	%	104.950	100.000	100.000		0.000	Y
7.16 % (6.7832 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.03.2017	23.03.2018	34 414 823	%	106.260	100.000	100.000		0.000	Y
4.28 % (4.0547 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.03.2017	23.03.2018	34 414 824	%	103.420	100.000	100.000		0.000	Y
4.81 % (4.5931 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	20'000.00	06.03.2017	23.03.2018	34 414 835	%	103.910	100.000	100.000		0.000	Y
4.84 % (4.6218 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.03.2017	23.03.2018	34 414 843	%	103.930	100.000	100.000		0.000	Y
5.3 % (5.0745 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.03.2017	23.03.2018	34 414 844	%	104.420	100.000	100.000		0.000	Y
9.39 % (8.9904 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.03.2017	23.03.2018	34 414 855	%	108.510	100.000	100.000		0.000	Y
10.37 % (9.9287 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.03.2017	23.03.2018	34 414 847	%	109.470	100.000	100.000		0.000	Y
9.17 % (8.7798 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.03.2017	23.03.2018	34 414 854	%	107.900	100.000	100.000		0.000	Y
5.24 % (5.0304 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	08.03.2017	23.03.2018	34 414 867	%	104.370	100.000	100.000		0.000	Y
4.57 % (4.3872 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.03.2017	23.03.2018	34 414 856	%	103.660	100.000	100.000		0.000	Y
5.31 % (5.0976 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.03.2017	23.03.2018	34 414 858	%	104.410	100.000	100.000		0.000	Y
4.56 % (4.3776 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.03.2017	23.03.2018	34 414 857	%	103.670	100.000	100.000		0.000	Y
5.29 % (5.0784 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.03.2017	23.03.2018	34 414 866	%	104.260	100.000	100.000		0.000	Y
4.92 % (4.7358 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.03.2017	23.03.2018	34 414 874	%	103.600	100.000	100.000		0.000	Y
4.35 % (4.1872 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.03.2017	23.03.2018	34 414 876	%	103.490	100.000	100.000		0.000	Y
11.43 % (11.0316 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.03.2017	23.03.2018	34 414 877	%	110.490	100.000	100.000		0.000	Y
6.71 % (6.4761 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.03.2017	23.03.2018	34 414 885	%	105.850	100.000	100.000		0.000	Y
4.05 % (3.9088 % p.a.) Reverse Convertible auf Richemeont	CHF	1'000.00	10.03.2017	23.03.2018	34 414 883	%	103.650	100.000	100.000		0.000	Y
5.64 % (5.4434 % p.a.) Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	1'000.00	10.03.2017	23.03.2018	34 414 882	%	105.260	100.000	100.000		0.000	Y
7.24 % (6.9877 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.03.2017	23.03.2018	34 414 884	%	105.840	100.000	100.000		0.000	Y
5.51 % (5.318 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.03.2017	23.03.2018	34 414 878	%	104.480	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
6.71 % (6.5286 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.03.2017	23.03.2018	34 414 891	%	104.810	100.000	100.000		0.000	Y
6.8 % (6.6162 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	13.03.2017	23.03.2018	34 414 888	%	105.740	100.000	100.000		0.000	Y
10.48 % (10.1968 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.03.2017	23.03.2018	34 414 893	%	108.710	100.000	100.000		0.000	Y
6.3 % (6.1297 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.03.2017	23.03.2018	34 414 894	%	105.050	100.000	100.000		0.000	Y
4.32 % (4.2146 % p.a.) Reverse Convertible auf Geberit N	CHF	1'000.00	14.03.2017	23.03.2018	34 414 901	%	103.420	100.000	100.000		0.000	Y
3.87 % (3.7756 % p.a.) Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	14.03.2017	23.03.2018	34 414 900	%	102.630	100.000	100.000		0.000	Y
5.64 % (5.5174 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.03.2017	23.03.2018	34 414 910	%	104.770	100.000	100.000		0.000	Y
8.92 % (8.7261 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.03.2017	23.03.2018	34 414 912	%	108.060	100.000	100.000		0.000	Y
3.16 % (3.0913 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.03.2017	23.03.2018	34 414 908	%	102.010	100.000	100.000		0.000	Y
3.74 % (3.6587 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.03.2017	23.03.2018	34 414 909	%	102.880	100.000	100.000		0.000	Y
5.64 % (5.5324 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.03.2017	23.03.2018	34 414 927	%	104.560	100.000	100.000		0.000	Y
2.17 % (2.1286 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.03.2017	23.03.2018	34 414 930	%	101.310	100.000	100.000		0.000	Y
7.55 % (7.406 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.03.2017	23.03.2018	34 414 926	%	106.260	100.000	100.000		0.000	Y
6.16 % (6.0425 % p.a.) Reverse Convertible auf Sunrise Comm Gr N	CHF	1'000.00	16.03.2017	23.03.2018	34 414 932	%	105.800	100.000	100.000		0.000	Y
4.38 % (4.3082 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.03.2017	23.03.2018	34 414 938	%	103.210	100.000	100.000		0.000	Y
9.54 % (9.3836 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.03.2017	23.03.2018	34 414 945	%	108.290	100.000	100.000		0.000	Y
4.24 % (4.1705 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.03.2017	23.03.2018	34 414 942	%	103.230	100.000	100.000		0.000	Y
4.42 % (4.3956 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.03.2017	23.03.2018	34 414 954	%	103.560	100.000	100.000		0.000	Y
5.49 % (5.4597 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	21.03.2017	23.03.2018	34 414 955	%	104.480	100.000	100.000		0.000	Y
5.54 % (5.5094 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.03.2017	23.03.2018	34 414 952	%	104.500	100.000	100.000		0.000	Y
3.43 % (3.4205 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.03.2017	23.03.2018	34 414 958	%	102.560	100.000	100.000		0.000	Y
4.7 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.03.2017	23.03.2018	34 414 967	%	103.840	100.000	100.000		0.000	Y
7.31 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.03.2017	23.03.2018	34 414 966	%	106.410	100.000	100.000		0.000	Y
6.16 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.03.2017	23.03.2018	34 414 970	%	105.300	100.000	100.000		0.000	Y
5.04 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.03.2017	23.03.2018	34 414 969	%	104.180	100.000	100.000		0.000	Y
4.93 % (4.9437 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.03.2017	23.03.2018	34 414 971	%	103.860	100.000	100.000		0.000	Y
5.25 % (6.1967 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.05.2017	23.03.2018	34 415 366	%	102.090	100.000	100.000		0.000	Y
5.08 % (7.5259 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.07.2017	23.03.2018	36 815 902	%	103.550	100.000	100.000		0.000	Y
9.85 % (17.8191 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.09.2017	23.03.2018	36 816 124	%	102.590	100.000	100.000		0.000	Y
5.02 % (9.2677 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.09.2017	23.03.2018	36 816 160	%	103.140	100.000	100.000		0.000	Y
2.7 % (5.1429 % p.a.) Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	1'000.00	14.09.2017	23.03.2018	36 816 184	%	100.880	100.000	100.000		0.000	Y
3.75 % (7.4586 % p.a.) Reverse Convertible auf u-blox Hldg N	CHF	1'000.00	22.09.2017	23.03.2018	36 816 232	%	103.340	100.000	100.000		0.000	Y
3.27 % (3.2519 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.03.2017	26.03.2018	34 414 980	%	102.370	100.000	100.000		0.000	Y
5.75 % (5.766 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.03.2017	26.03.2018	34 414 981	%	104.810	100.000	100.000		0.000	Y
5.76 % (5.776 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.03.2017	26.03.2018	34 414 982	%	104.820	100.000	100.000		0.000	Y
5.62 % (5.6357 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.03.2017	26.03.2018	34 414 983	%	104.260	100.000	100.000		0.000	Y
4.71 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.03.2017	27.03.2018	34 414 991	%	103.860	100.000	100.000		0.000	Y
7.39 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.03.2017	29.03.2018	34 415 011	%	106.540	100.000	100.000		0.000	Y
4.15 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.03.2017	29.03.2018	34 415 017	%	103.260	100.000	100.000		0.000	Y
11.59 % (11.6547 % p.a.) Reverse Convertible auf Leonteq N	CHF	1'000.00	05.04.2017	03.04.2018	34 415 073	%	111.260	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.12 % (9.8043 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.09.2017	03.04.2018	36 816 244	%	99.940	100.000	100.000		0.000	Y
6.92 % (6.844 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	05.04.2017	09.04.2018	34 415 064	%	105.860	100.000	100.000		0.000	Y
8.49 % (8.3737 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.04.2017	10.04.2018	34 415 065	%	107.450	100.000	100.000		0.000	Y
7.6 % (7.4959 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.04.2017	10.04.2018	34 415 075	%	66.460	100.000	100.000		0.000	Y
12.45 % (12.3471 % p.a.) Reverse Convertible auf Leonteq N	CHF	1'000.00	07.04.2017	10.04.2018	34 415 094	%	112.140	100.000	100.000		0.000	Y
4.48 % (4.443 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	07.04.2017	10.04.2018	34 415 095	%	103.490	100.000	100.000		0.000	Y
4.92 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.04.2017	11.04.2018	34 415 101	%	103.230	100.000	100.000		0.000	Y
4.28 % (4.3039 % p.a.) Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	1'000.00	21.04.2017	19.04.2018	34 415 143	%	103.570	100.000	100.000		0.000	Y
7.28 % (7.3618 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.04.2017	20.04.2018	34 415 153	%	106.470	100.000	100.000		0.000	Y
8.38 % (7.6182 % p.a.) Reverse Convertible auf LafargeHolcim N	CHF	5'000.00	17.03.2017	23.04.2018	34 414 943	%	101.460	100.000	100.000	23.10.	0.000	N
7.63 % (7.0612 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.03.2017	23.04.2018	34 414 979	%	106.810	100.000	100.000		0.000	Y
5.49 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.04.2017	24.04.2018	34 415 154	%	103.140	100.000	100.000		0.000	Y
8.13 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.04.2017	25.04.2018	34 415 175	%	107.120	100.000	100.000		0.000	Y
6.89 % (4.5764 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.10.2016	27.04.2018	32 771 849	%	106.080	100.000	100.000		0.000	Y
8.08 % (7.4015 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.03.2017	27.04.2018	34 414 972	%	107.230	100.000	100.000		0.000	Y
6.03 % (5.5662 % p.a.) Reverse Convertible auf UBS Group N	CHF	1'000.00	27.03.2017	27.04.2018	34 414 996	%	105.690	100.000	100.000		0.000	Y
8.58 % (7.92 % p.a.) Reverse Convertible auf CS Group N	CHF	1'000.00	27.03.2017	27.04.2018	34 414 995	%	108.220	100.000	100.000		0.000	Y
8.24 % (7.6062 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.03.2017	27.04.2018	34 414 989	%	107.420	100.000	100.000		0.000	Y
4.92 % (4.5415 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.03.2017	27.04.2018	34 414 988	%	103.730	100.000	100.000		0.000	Y
5.89 % (5.4369 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	27.03.2017	27.04.2018	34 414 992	%	104.810	100.000	100.000		0.000	Y
6.45 % (5.9538 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	27.03.2017	27.04.2018	34 414 993	%	104.990	100.000	100.000		0.000	Y
5.25 % (4.8586 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.03.2017	27.04.2018	34 415 006	%	104.430	100.000	100.000		0.000	Y
6.48 % (5.9969 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	28.03.2017	27.04.2018	34 415 003	%	105.520	100.000	100.000		0.000	Y
5.2 % (4.8123 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.03.2017	27.04.2018	34 415 008	%	104.390	100.000	100.000		0.000	Y
8.01 % (7.4129 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.03.2017	27.04.2018	34 414 997	%	107.180	100.000	100.000		0.000	Y
5.5 % (5.09 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.03.2017	27.04.2018	34 414 999	%	104.680	100.000	100.000		0.000	Y
7.07 % (6.5429 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	28.03.2017	27.04.2018	34 415 001	%	106.040	100.000	100.000		0.000	Y
4.12 % (3.8227 % p.a.) Reverse Convertible auf Schindler Hldg PS	CHF	1'000.00	29.03.2017	27.04.2018	34 415 015	%	103.650	100.000	100.000		0.000	Y
7.24 % (6.7175 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.03.2017	27.04.2018	34 415 020	%	106.430	100.000	100.000		0.000	Y
7.92 % (7.3674 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.03.2017	27.04.2018	34 415 025	%	106.510	100.000	100.000		0.000	Y
5.17 % (4.8093 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.03.2017	27.04.2018	34 415 023	%	104.370	100.000	100.000		0.000	Y
3.4 % (3.1628 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.03.2017	27.04.2018	34 415 031	%	102.600	100.000	100.000		0.000	Y
7.27 % (6.7628 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.03.2017	27.04.2018	34 415 041	%	105.990	100.000	100.000		0.000	Y
9.84 % (9.1535 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.03.2017	27.04.2018	34 415 040	%	106.630	100.000	100.000		0.000	Y
5.44 % (5.0605 % p.a.) Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	1'000.00	31.03.2017	27.04.2018	34 415 042	%	104.750	100.000	100.000		0.000	Y
5.39 % (5.014 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	31.03.2017	27.04.2018	34 415 043	%	104.580	100.000	100.000		0.000	Y
6.68 % (6.214 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.03.2017	27.04.2018	34 415 046	%	105.380	100.000	100.000		0.000	Y
9.07 % (8.4372 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.03.2017	27.04.2018	34 415 036	%	107.130	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
6.33 % (5.9344 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.04.2017	27.04.2018	34 415 056	%	105.370	100.000	100.000		0.000	Y
9.68 % (9.075 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.04.2017	27.04.2018	34 415 058	%	108.620	100.000	100.000		0.000	Y
8.76 % (8.2555 % p.a.) Reverse Convertible auf Basilea Pharmaceu N	CHF	1'000.00	05.04.2017	27.04.2018	34 415 066	%	98.950	100.000	100.000		0.000	Y
9.06 % (8.5382 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.04.2017	27.04.2018	34 415 069	%	108.180	100.000	100.000		0.000	Y
5.74 % (5.4094 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.04.2017	27.04.2018	34 415 071	%	104.140	100.000	100.000		0.000	Y
4.92 % (4.6366 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	05.04.2017	27.04.2018	34 415 072	%	103.710	100.000	100.000		0.000	Y
4.5 % (4.2408 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.04.2017	27.04.2018	34 415 074	%	103.690	100.000	100.000		0.000	Y
5.33 % (5.0362 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.04.2017	27.04.2018	34 415 078	%	104.520	100.000	100.000		0.000	Y
9.48 % (8.9811 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.04.2017	27.04.2018	34 415 089	%	108.570	100.000	100.000		0.000	Y
8.31 % (7.8726 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.04.2017	27.04.2018	34 415 091	%	107.370	100.000	100.000		0.000	Y
5.28 % (5.0021 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.04.2017	27.04.2018	34 415 092	%	104.380	100.000	100.000		0.000	Y
8.37 % (7.9295 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.04.2017	27.04.2018	34 415 090	%	106.840	100.000	100.000		0.000	Y
6.23 % (5.9491 % p.a.) Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	10.04.2017	27.04.2018	34 415 100	%	105.470	100.000	100.000		0.000	Y
11.44 % (10.9532 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.04.2017	27.04.2018	34 415 102	%	110.330	100.000	100.000		0.000	Y
8.81 % (8.4351 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.04.2017	27.04.2018	34 415 104	%	107.940	100.000	100.000		0.000	Y
4.21 % (4.0416 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.04.2017	27.04.2018	34 415 107	%	102.720	100.000	100.000		0.000	Y
8.69 % (8.3424 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.04.2017	27.04.2018	34 415 108	%	107.310	100.000	100.000		0.000	Y
9.05 % (8.7112 % p.a.) Reverse Convertible auf UBS Group N	CHF	1'000.00	13.04.2017	27.04.2018	34 415 109	%	107.700	100.000	100.000		0.000	Y
7.16 % (6.9854 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.04.2017	27.04.2018	34 415 112	%	106.040	100.000	100.000		0.000	Y
6.95 % (6.7805 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.04.2017	27.04.2018	34 415 115	%	106.000	100.000	100.000		0.000	Y
6.21 % (6.075 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.04.2017	27.04.2018	34 415 124	%	105.300	100.000	100.000		0.000	Y
2.01 % (1.9663 % p.a.) Reverse Convertible auf ABB N	CHF	1'000.00	19.04.2017	27.04.2018	34 415 121	%	101.550	100.000	100.000		0.000	Y
4.89 % (4.7837 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.04.2017	27.04.2018	34 415 123	%	104.070	100.000	100.000		0.000	Y
2.48 % (2.4261 % p.a.) Reverse Convertible auf Nestle N	CHF	1'000.00	19.04.2017	27.04.2018	34 415 120	%	102.080	100.000	100.000		0.000	Y
5.49 % (5.4 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.04.2017	27.04.2018	34 415 148	%	104.670	100.000	100.000		0.000	Y
9.79 % (9.7091 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.04.2017	27.04.2018	34 415 155	%	108.000	100.000	100.000		0.000	Y
7.41 % (7.3691 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.04.2017	27.04.2018	34 415 161	%	105.420	100.000	100.000		0.000	Y
8.19 % (8.1448 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	25.04.2017	27.04.2018	34 415 163	%	105.490	100.000	100.000		0.000	Y
10.58 % (10.5215 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	25.04.2017	27.04.2018	34 415 164	%	109.670	100.000	100.000		0.000	Y
7.5 % (7.4586 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.04.2017	27.04.2018	34 415 165	%	105.870	100.000	100.000		0.000	Y
6.33 % (6.295 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.04.2017	27.04.2018	34 415 166	%	105.520	100.000	100.000		0.000	Y
11.64 % (11.6078 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.04.2017	27.04.2018	34 415 185	%	110.220	100.000	100.000		0.000	Y
3.14 % (3.1313 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	50'000.00	26.04.2017	27.04.2018	34 415 183	%	102.240	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.04.2017	27.04.2018	34 415 202	%	76.630	100.000	100.000		0.000	Y
4.13 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.04.2017	27.04.2018	34 415 198	%	103.290	100.000	100.000		0.000	Y
6.06 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.04.2017	27.04.2018	34 415 195	%	105.160	100.000	100.000		0.000	Y
3.38 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.04.2017	27.04.2018	34 415 194	%	102.400	100.000	100.000		0.000	Y
4.56 % (5.5837 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.07.2017	27.04.2018	36 815 826	%	103.440	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4.7 % (6.5077 % p.a.) Reverse Convertible auf UBS Group N	CHF	1'000.00	07.08.2017	27.04.2018	36 815 960	%	103.030	100.000	100.000		0.000	Y
4.35 % (6.418 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.08.2017	27.04.2018	36 816 044	%	101.560	100.000	100.000		0.000	Y
2.94 % (5.1629 % p.a.) Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	1'000.00	02.10.2017	27.04.2018	36 816 306	%	97.840	100.000	100.000		0.000	Y
4.3 % (7.5512 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.10.2017	27.04.2018	36 816 304	%	99.760	100.000	100.000		0.000	Y
1.93 % (3.6377 % p.a.) Reverse Convertible auf ARYZTA N	CHF	1'000.00	16.10.2017	27.04.2018	36 816 398	%	101.310	100.000	100.000		0.000	Y
6.69 % (12.7429 % p.a.) Reverse Convertible auf ARYZTA N	CHF	1'000.00	18.10.2017	27.04.2018	36 816 405	%	105.360	100.000	100.000		0.000	Y
2.57 % (4.9213 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.10.2017	27.04.2018	36 816 418	%	98.550	100.000	100.000		0.000	Y
2.72 % (5.3217 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.10.2017	27.04.2018	36 816 427	%	98.480	100.000	100.000		0.000	Y
3.92 % (7.7538 % p.a.) Reverse Convertible auf UBS Group N	CHF	1'000.00	25.10.2017	27.04.2018	36 816 442	%	101.600	100.000	100.000		0.000	Y
6.63 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	03.05.2017	03.05.2018	34 415 238	%	105.280	100.000	100.000		0.000	Y
5.68 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.05.2017	03.05.2018	34 415 229	%	104.610	100.000	100.000		0.000	Y
6.05 % (6.0166 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.05.2017	07.05.2018	34 415 265	%	104.930	100.000	100.000		0.000	Y
4.94 % (4.9127 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	05.05.2017	07.05.2018	34 415 266	%	103.670	100.000	100.000		0.000	Y
7.67 % (7.6276 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.05.2017	07.05.2018	34 415 267	%	106.430	100.000	100.000		0.000	Y
5.86 % (5.8276 % p.a.) Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	1'000.00	05.05.2017	07.05.2018	34 415 273	%	103.680	100.000	100.000		0.000	Y
5.9 % (5.8674 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.05.2017	07.05.2018	34 415 262	%	104.920	100.000	100.000		0.000	Y
6.04 % (6.0066 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.05.2017	07.05.2018	34 415 269	%	104.690	100.000	100.000		0.000	Y
3.65 % (5.9727 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.09.2017	07.05.2018	36 816 274	%	100.260	100.000	100.000		0.000	Y
7.27 % Reverse Convertible auf UBS Group N	CHF	1'000.00	08.05.2017	08.05.2018	34 415 287	%	105.350	100.000	100.000		0.000	Y
6.28 % (6.3328 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.05.2017	08.05.2018	34 415 313	%	104.840	100.000	100.000		0.000	Y
5.02 % (5.0061 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.05.2017	11.05.2018	34 415 306	%	103.360	100.000	100.000		0.000	Y
5.49 % (4.575 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.03.2017	14.05.2018	34 414 798	%	104.350	100.000	100.000		0.000	Y
3.99 % (3.957 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.05.2017	14.05.2018	34 415 314	%	101.860	100.000	100.000		0.000	Y
10.47 % (10.3835 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.05.2017	14.05.2018	34 415 316	%	106.950	100.000	100.000		0.000	Y
7.84 % (7.7752 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.05.2017	14.05.2018	34 415 317	%	106.050	100.000	100.000		0.000	Y
7.77 % (7.7058 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.05.2017	15.05.2018	34 415 328	%	105.330	100.000	100.000		0.000	Y
4.41 % (4.3736 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.05.2017	15.05.2018	34 415 327	%	102.720	100.000	100.000		0.000	Y
4.83 % (4.8166 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.05.2017	17.05.2018	34 415 346	%	102.460	100.000	100.000		0.000	Y
7.28 % (7.2598 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.05.2017	18.05.2018	34 415 351	%	104.670	100.000	100.000		0.000	Y
9.56 % (7.8218 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.03.2017	23.05.2018	34 414 812	%	108.740	100.000	100.000		0.000	Y
4.95 % (4.9363 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.05.2017	25.05.2018	34 415 395	%	103.440	100.000	100.000		0.000	Y
4.91 % (4.8964 % p.a.) Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	1'000.00	24.05.2017	25.05.2018	34 415 392	%	99.350	100.000	100.000		0.000	Y
13.32 % (6.4625 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.05.2016	28.05.2018	30 507 159	%	112.200	100.000	100.000		0.000	Y
11.65 % (5.7531 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.05.2016	28.05.2018	30 507 277	%	109.880	100.000	100.000		0.000	Y
7.65 % (6.2591 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.03.2017	28.05.2018	34 414 865	%	106.880	100.000	100.000		0.000	Y
7.68 % (7.0892 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.04.2017	28.05.2018	34 415 213	%	106.050	100.000	100.000		0.000	Y
7.23 % (6.743 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	02.05.2017	28.05.2018	34 415 220	%	105.370	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4.48 % (4.1782 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.05.2017	28.05.2018	34 415 223	%	103.570	100.000	100.000		0.000	Y
5.45 % (5.0961 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	03.05.2017	28.05.2018	34 415 234	%	104.360	100.000	100.000		0.000	Y
7.24 % (6.7699 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.05.2017	28.05.2018	34 415 232	%	105.260	100.000	100.000		0.000	Y
3.23 % (3.0203 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.05.2017	28.05.2018	34 415 225	%	100.890	100.000	100.000		0.000	Y
7.33 % (6.854 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.05.2017	28.05.2018	34 415 226	%	105.370	100.000	100.000		0.000	Y
7.07 % (6.6281 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.05.2017	28.05.2018	34 415 247	%	104.950	100.000	100.000		0.000	Y
5.93 % (5.5594 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	04.05.2017	28.05.2018	34 415 246	%	104.890	100.000	100.000		0.000	Y
6.63 % (6.2156 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	04.05.2017	28.05.2018	34 415 248	%	104.970	100.000	100.000		0.000	Y
9.47 % (8.9716 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.05.2017	28.05.2018	34 415 283	%	105.560	100.000	100.000		0.000	Y
11.5 % (10.8947 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.05.2017	28.05.2018	34 415 285	%	109.210	100.000	100.000		0.000	Y
10.68 % (10.1179 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.05.2017	28.05.2018	34 415 284	%	109.380	100.000	100.000		0.000	Y
8.51 % (8.0621 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.05.2017	28.05.2018	34 415 276	%	106.050	100.000	100.000		0.000	Y
6.32 % (5.9874 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.05.2017	28.05.2018	34 415 274	%	105.430	100.000	100.000		0.000	Y
4.19 % (3.9695 % p.a.) Reverse Convertible auf Galenica N	CHF	5'000.00	08.05.2017	28.05.2018	34 415 280	%	103.380	100.000	100.000		0.000	Y
5.32 % (5.0667 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.05.2017	28.05.2018	34 415 305	%	102.730	100.000	100.000		0.000	Y
6.83 % (6.5048 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	10.05.2017	28.05.2018	34 415 301	%	103.030	100.000	100.000		0.000	Y
5.52 % (5.2711 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.05.2017	28.05.2018	34 415 315	%	104.130	100.000	100.000		0.000	Y
4.98 % (4.7554 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.05.2017	28.05.2018	34 415 312	%	103.720	100.000	100.000		0.000	Y
7.1 % (6.7979 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.05.2017	28.05.2018	34 415 323	%	103.060	100.000	100.000		0.000	Y
4.41 % (4.2223 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.05.2017	28.05.2018	34 415 325	%	103.510	100.000	100.000		0.000	Y
5.48 % (5.2468 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	20'000.00	12.05.2017	28.05.2018	34 415 326	%	102.920	100.000	100.000		0.000	Y
10.31 % (9.9507 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.05.2017	28.05.2018	34 415 333	%	109.150	100.000	100.000		0.000	Y
6.45 % (6.2252 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	15.05.2017	28.05.2018	34 415 334	%	103.770	100.000	100.000		0.000	Y
4.86 % (4.6906 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.05.2017	28.05.2018	34 415 339	%	102.190	100.000	100.000		0.000	Y
7.29 % (7.0548 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.05.2017	28.05.2018	34 415 344	%	104.840	100.000	100.000		0.000	Y
4.65 % (4.5 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.05.2017	28.05.2018	34 415 341	%	103.540	100.000	100.000		0.000	Y
7.17 % (6.9387 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.05.2017	28.05.2018	34 415 343	%	104.700	100.000	100.000		0.000	Y
7.37 % (7.1515 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.05.2017	28.05.2018	34 415 352	%	103.890	100.000	100.000		0.000	Y
5.7 % (5.5459 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.05.2017	28.05.2018	34 415 355	%	103.210	100.000	100.000		0.000	Y
5.08 % (4.9427 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	18.05.2017	28.05.2018	34 415 357	%	102.300	100.000	100.000		0.000	Y
5.95 % (5.8049 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.05.2017	28.05.2018	34 415 370	%	103.500	100.000	100.000		0.000	Y
6.46 % (6.3541 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.05.2017	28.05.2018	34 415 375	%	103.580	100.000	100.000		0.000	Y
4.36 % (4.3003 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	23.05.2017	28.05.2018	34 415 376	%	100.970	100.000	100.000		0.000	Y
8.54 % (8.4462 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.05.2017	28.05.2018	34 415 394	%	104.780	100.000	100.000		0.000	Y
8.79 % (8.6934 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.05.2017	28.05.2018	34 415 397	%	105.220	100.000	100.000		0.000	Y
4.78 % (4.7275 % p.a.) Reverse Convertible auf Schindler Hldg PS	CHF	1'000.00	24.05.2017	28.05.2018	34 415 398	%	103.720	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
7.43 % (7.3484 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	100'000.00	24.05.2017	28.05.2018	34 415 399	%	104.550	100.000	100.000		0.000	Y
7.12 % (7.0807 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.05.2017	28.05.2018	34 415 402	%	104.790	100.000	100.000		0.000	Y
3.56 % (3.5403 % p.a.) Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	1'000.00	26.05.2017	28.05.2018	34 415 404	%	101.250	100.000	100.000		0.000	Y
5.9 % (5.9164 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.05.2017	28.05.2018	34 415 411	%	104.530	100.000	100.000		0.000	Y
5.1 % (5.1285 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.05.2017	28.05.2018	34 415 421	%	103.720	100.000	100.000		0.000	Y
4.48 % (7.9842 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.11.2017	28.05.2018	36 816 529	%	100.590	100.000	100.000		0.000	Y
2.2 % (4 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.11.2017	28.05.2018	36 816 574	%	97.830	100.000	100.000		0.000	Y
1.33 % (2.4554 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.11.2017	28.05.2018	36 816 584	%	97.250	100.000	100.000		0.000	Y
8.81 % (8.1115 % p.a.) Reverse Convertible auf Tesla Rg	CHF	1'000.00	28.04.2017	29.05.2018	34 415 211	%	105.190	100.000	100.000		0.000	Y
5.86 % (5.3954 % p.a.) Reverse Convertible auf Tesla Rg	CHF	1'000.00	28.04.2017	29.05.2018	34 415 212	%	103.940	100.000	100.000		0.000	Y
4.51 % (4.5226 % p.a.) Reverse Convertible auf CS Group N	CHF	1'000.00	30.05.2017	29.05.2018	34 415 424	%	104.140	100.000	100.000		0.000	Y
9.39 % (9.4162 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.05.2017	29.05.2018	34 415 422	%	106.170	100.000	100.000		0.000	Y
3.51 % (6.0459 % p.a.) Reverse Convertible auf Tesla Rg	CHF	1'000.00	31.10.2017	29.05.2018	36 816 479	%	96.870	100.000	100.000		0.000	Y
9.96 % (8.2808 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.03.2017	31.05.2018	34 414 941	%	108.850	100.000	100.000		0.000	Y
6.25 % (6.2674 % p.a.) Reverse Convertible auf LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	01.06.2017	31.05.2018	34 415 439	%	99.870	100.000	100.000		0.000	Y
8.07 % (4.0294 % p.a.) Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	03.06.2016	04.06.2018	30 507 385	%	105.920	100.000	100.000		0.000	Y
3.48 % (3.3055 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.05.2017	04.06.2018	34 415 337	%	102.510	100.000	100.000		0.000	Y
4.78 % (4.7536 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.06.2017	04.06.2018	34 415 447	%	100.210	100.000	100.000		0.000	Y
2.47 % (2.4496 % p.a.) Reverse Convertible auf Caterpillar Rg	CHF	1'000.00	02.06.2017	05.06.2018	34 415 452	%	102.200	100.000	100.000		0.000	Y
8.88 % (8.9047 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.06.2017	06.06.2018	34 415 470	%	106.660	100.000	100.000		0.000	Y
9.25 % (8.263 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.04.2017	07.06.2018	34 415 152	%	108.010	100.000	100.000		0.000	Y
5.17 % (5.1844 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.06.2017	07.06.2018	34 415 483	%	102.550	100.000	100.000		0.000	Y
4.42 % (4.4323 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.06.2017	07.06.2018	34 415 477	%	102.930	100.000	100.000		0.000	Y
10.01 % (10.0379 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.06.2017	08.06.2018	34 415 484	%	98.100	100.000	100.000		0.000	Y
4.86 % (4.8735 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.06.2017	11.06.2018	34 415 502	%	103.920	100.000	100.000		0.000	Y
3.69 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.06.2017	13.06.2018	34 415 503	%	100.490	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible auf ams I	CHF	1'000.00	14.06.2017	14.06.2018	34 415 515	%	103.950	100.000	100.000		0.000	Y
9.02 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	15.06.2017	15.06.2018	34 415 525	%	107.060	100.000	100.000		0.000	Y
3.99 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.06.2017	15.06.2018	34 415 522	%	100.200	100.000	100.000		0.000	Y
11.5 % (11.532 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.06.2017	15.06.2018	34 415 531	%	107.130	100.000	100.000		0.000	Y
5.11 % (5.0818 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.06.2017	18.06.2018	34 415 538	%	101.560	100.000	100.000		0.000	Y
5.14 % (5.1116 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.06.2017	18.06.2018	34 415 537	%	101.500	100.000	100.000		0.000	Y
6.49 % (6.5814 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.06.2017	18.06.2018	36 815 768	%	95.030	100.000	100.000		0.000	Y
11.84 % (9.2863 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.03.2017	22.06.2018	34 414 896	%	110.910	100.000	100.000		0.000	Y
3.11 % (2.5273 % p.a.) Reverse Convertible auf dormakaba Hldg N	CHF	1'000.00	29.03.2017	22.06.2018	34 415 014	%	102.820	100.000	100.000		0.000	Y
8.51 % (7.999 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.05.2017	22.06.2018	34 415 418	%	100.230	100.000	100.000		0.000	Y
11.92 % (11.2042 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.05.2017	22.06.2018	34 415 413	%	109.460	100.000	100.000		0.000	Y
3.54 % (3.3274 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	29.05.2017	22.06.2018	34 415 412	%	101.980	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
3.75 % (3.534 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.05.2017	22.06.2018	34 415 425	%	94.010	100.000	100.000		0.000	Y
7.96 % (7.5016 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	100'000.00	30.05.2017	22.06.2018	34 415 419	%	101.600	100.000	100.000		0.000	Y
5.56 % (5.2398 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.05.2017	22.06.2018	34 415 431	%	100.840	100.000	100.000		0.000	Y
5.28 % (4.9759 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.05.2017	22.06.2018	34 415 432	%	101.620	100.000	100.000		0.000	Y
2.05 % (1.9319 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.05.2017	22.06.2018	34 415 428	%	99.310	100.000	100.000		0.000	Y
6.28 % (5.9183 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.05.2017	22.06.2018	34 415 429	%	103.970	100.000	100.000		0.000	Y
7.39 % (6.9827 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.06.2017	22.06.2018	34 415 441	%	100.410	100.000	100.000		0.000	Y
4.93 % (4.6583 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.06.2017	22.06.2018	34 415 437	%	103.790	100.000	100.000		0.000	Y
3.91 % (3.7436 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.06.2017	22.06.2018	34 415 458	%	100.100	100.000	100.000		0.000	Y
4.65 % (4.4521 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.06.2017	22.06.2018	34 415 456	%	101.180	100.000	100.000		0.000	Y
5.67 % (5.4287 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.06.2017	22.06.2018	34 415 460	%	102.370	100.000	100.000		0.000	Y
5.75 % (5.5053 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.06.2017	22.06.2018	34 415 457	%	102.430	100.000	100.000		0.000	Y
6.93 % (6.6528 % p.a.) Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	1'000.00	07.06.2017	22.06.2018	34 415 472	%	97.150	100.000	100.000		0.000	Y
4.62 % (4.4352 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.06.2017	22.06.2018	34 415 473	%	99.050	100.000	100.000		0.000	Y
5.76 % (5.5444 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.06.2017	22.06.2018	34 415 476	%	102.320	100.000	100.000		0.000	Y
5.31 % (5.1112 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.06.2017	22.06.2018	34 415 475	%	104.100	100.000	100.000		0.000	Y
5.78 % (5.5636 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.06.2017	22.06.2018	34 415 481	%	102.940	100.000	100.000		0.000	Y
5.51 % (5.3037 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.06.2017	22.06.2018	34 415 482	%	104.160	100.000	100.000		0.000	Y
6.27 % (6.0515 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.06.2017	22.06.2018	34 415 492	%	102.390	100.000	100.000		0.000	Y
4.04 % (3.8992 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	09.06.2017	22.06.2018	34 415 485	%	101.280	100.000	100.000		0.000	Y
3.41 % (3.2912 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.06.2017	22.06.2018	34 415 491	%	101.110	100.000	100.000		0.000	Y
6.88 % (6.6402 % p.a.) Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	1'000.00	09.06.2017	22.06.2018	34 415 489	%	99.470	100.000	100.000		0.000	Y
6.38 % (6.1576 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.06.2017	22.06.2018	34 415 493	%	102.270	100.000	100.000		0.000	Y
5.48 % (5.3319 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.06.2017	22.06.2018	34 415 497	%	102.490	100.000	100.000		0.000	Y
6.26 % (6.0908 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.06.2017	22.06.2018	34 415 500	%	102.220	100.000	100.000		0.000	Y
4.4 % (4.2811 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.06.2017	22.06.2018	34 415 501	%	101.680	100.000	100.000		0.000	Y
6.68 % (6.4995 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.06.2017	22.06.2018	34 415 496	%	102.690	100.000	100.000		0.000	Y
6.81 % (6.6259 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.06.2017	22.06.2018	34 415 498	%	105.280	100.000	100.000		0.000	Y
6.6 % (6.439 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.06.2017	22.06.2018	34 415 505	%	100.050	100.000	100.000		0.000	Y
4.22 % (4.1283 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.06.2017	22.06.2018	34 415 514	%	102.440	100.000	100.000		0.000	Y
3.48 % (3.4043 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.06.2017	22.06.2018	34 415 516	%	101.000	100.000	100.000		0.000	Y
3.11 % (3.0424 % p.a.) Reverse Convertible auf Baloise Hldg N	CHF	5'000.00	14.06.2017	22.06.2018	34 415 517	%	100.680	100.000	100.000		0.000	Y
5.76 % (5.6501 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.06.2017	22.06.2018	34 415 528	%	99.170	100.000	100.000		0.000	Y
7.18 % (7.0431 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.06.2017	22.06.2018	34 415 521	%	103.660	100.000	100.000		0.000	Y
6.21 % (6.0916 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.06.2017	22.06.2018	34 415 527	%	99.610	100.000	100.000		0.000	Y
6.22 % (6.118 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.06.2017	22.06.2018	34 415 539	%	103.600	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4.16 % (4.1256 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.06.2017	22.06.2018	34 415 544	%	101.630	100.000	100.000		0.000	Y
4.4 % (4.3757 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.06.2017	22.06.2018	34 415 553	%	102.460	100.000	100.000		0.000	Y
3.12 % (3.1028 % p.a.) Reverse Convertible auf Vifor Pharma N	CHF	1'000.00	20.06.2017	22.06.2018	34 415 547	%	102.340	100.000	100.000		0.000	Y
4.03 % (4.0188 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	21.06.2017	22.06.2018	34 415 555	%	102.180	100.000	100.000		0.000	Y
4.32 % (4.308 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.06.2017	22.06.2018	34 415 556	%	101.420	100.000	100.000		0.000	Y
7.18 % (7.1601 % p.a.) Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	1'000.00	21.06.2017	22.06.2018	34 415 558	%	97.390	100.000	100.000		0.000	Y
5.83 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.06.2017	22.06.2018	34 415 567	%	103.230	100.000	100.000		0.000	Y
3.16 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.06.2017	22.06.2018	34 415 573	%	101.660	100.000	100.000		0.000	Y
5.39 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.06.2017	22.06.2018	34 415 570	%	103.150	100.000	100.000		0.000	Y
5.17 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.06.2017	22.06.2018	34 415 566	%	104.050	100.000	100.000		0.000	Y
4.21 % Reverse Convertible auf Vifor Pharma N	CHF	1'000.00	22.06.2017	22.06.2018	34 415 572	%	102.570	100.000	100.000		0.000	Y
5.46 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.06.2017	22.06.2018	34 415 571	%	103.090	100.000	100.000		0.000	Y
6.44 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.06.2017	22.06.2018	34 415 568	%	104.570	100.000	100.000		0.000	Y
4.31 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.06.2017	22.06.2018	34 415 569	%	101.700	100.000	100.000		0.000	Y
4.2 % (6.6026 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.11.2017	22.06.2018	36 816 504	%	98.860	100.000	100.000		0.000	Y
6.54 % (10.4177 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.11.2017	22.06.2018	36 816 528	%	95.130	100.000	100.000		0.000	Y
8.32 % (14.6824 % p.a.) Reverse Convertible auf Meyer Burger N	CHF	1'000.00	28.11.2017	22.06.2018	36 816 687	%	100.830	100.000	100.000		0.000	Y
7.43 % (13.5777 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.12.2017	22.06.2018	36 816 733	%	98.110	100.000	100.000		0.000	Y
1.91 % (3.5262 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.12.2017	22.06.2018	36 816 754	%	98.720	100.000	100.000		0.000	Y
7.7 % (15.2308 % p.a.) Reverse Convertible auf ams I	CHF	1'000.00	20.12.2017	22.06.2018	36 816 866	%	98.700	100.000	100.000		0.000	Y
4.14 % (5.52 % p.a.) Reverse Convertible auf Tesla Rg	CHF	1'000.00	26.09.2017	26.06.2018	36 816 258	%	97.220	100.000	100.000		0.000	Y
5.43 % (4.9614 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.05.2017	27.06.2018	34 415 382	%	70.010	100.000	100.000		0.000	Y
4.51 % (4.1845 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.05.2017	27.06.2018	34 415 414	%	90.200	100.000	100.000		0.000	Y
3.09 % (3.056 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.06.2017	27.06.2018	36 815 771	%	101.720	100.000	100.000		0.000	Y
8.42 % (8.3275 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.06.2017	27.06.2018	36 815 765	%	106.190	100.000	100.000		0.000	Y
3.59 % (3.5702 % p.a.) Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	30.06.2017	02.07.2018	36 815 820	%	100.100	100.000	100.000		0.000	Y
7.39 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	05.07.2017	05.07.2018	36 815 840	%	104.040	100.000	100.000		0.000	Y
8.43 % (6.6553 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.03.2017	06.07.2018	34 415 050	%	106.740	100.000	100.000		0.000	Y
11.35 % (9.1002 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.04.2017	06.07.2018	34 415 093	%	108.980	100.000	100.000		0.000	Y
11.33 % (9.0842 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.04.2017	06.07.2018	34 415 097	%	108.950	100.000	100.000		0.000	Y
9.98 % (4.8161 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.07.2016	27.07.2018	30 507 576	%	108.990	100.000	100.000		0.000	Y
8.17 % (4.018 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.07.2016	27.07.2018	32 771 208	%	106.920	100.000	100.000		0.000	Y
5.53 % (3.4683 % p.a.) Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	23.12.2016	27.07.2018	34 414 223	%	104.150	100.000	100.000		0.000	Y
6.42 % (4.2098 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.01.2017	27.07.2018	34 414 347	%	104.800	100.000	100.000		0.000	Y
7.70 % (5.0584 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.01.2017	27.07.2018	34 414 355	%	106.790	100.000	100.000		0.000	Y
8.18 % (5.3737 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.01.2017	27.07.2018	34 414 352	%	107.340	100.000	100.000		0.000	Y
8.29 % (6.2566 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.03.2017	27.07.2018	34 415 033	%	106.750	100.000	100.000		0.000	Y
10.28 % (9.3929 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.06.2017	27.07.2018	36 815 764	%	100.040	100.000	100.000		0.000	Y
4.58 % (4.2169 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.06.2017	27.07.2018	36 815 790	%	103.040	100.000	100.000		0.000	Y
4.81 % (4.4286 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.06.2017	27.07.2018	36 815 792	%	101.280	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
2.7 % (2.4923 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.06.2017	27.07.2018	36 815 800	%	100.820	100.000	100.000		0.000	Y
6.87 % (6.3415 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	20'000.00	27.06.2017	27.07.2018	36 815 795	%	96.710	100.000	100.000		0.000	Y
4.71 % (4.3477 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.06.2017	27.07.2018	36 815 799	%	102.390	100.000	100.000		0.000	Y
8.26 % (7.6837 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.06.2017	27.07.2018	36 815 813	%	103.140	100.000	100.000		0.000	Y
5.24 % (4.8744 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.06.2017	27.07.2018	36 815 819	%	100.880	100.000	100.000		0.000	Y
4.52 % (4.2047 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.06.2017	27.07.2018	36 815 818	%	101.490	100.000	100.000		0.000	Y
4.69 % (4.3628 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.06.2017	27.07.2018	36 815 812	%	100.590	100.000	100.000		0.000	Y
5.52 % (5.2021 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.07.2017	27.07.2018	36 815 843	%	101.340	100.000	100.000		0.000	Y
5.58 % (5.2586 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.07.2017	27.07.2018	36 815 842	%	101.960	100.000	100.000		0.000	Y
5.49 % (5.1738 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.07.2017	27.07.2018	36 815 841	%	102.280	100.000	100.000		0.000	Y
7.05 % (6.6614 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.07.2017	27.07.2018	36 815 850	%	100.760	100.000	100.000		0.000	Y
8.35 % (7.8898 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.07.2017	27.07.2018	36 815 846	%	102.470	100.000	100.000		0.000	Y
4.35 % (4.1211 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.07.2017	27.07.2018	36 815 852	%	100.750	100.000	100.000		0.000	Y
4.3 % (4.0737 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.07.2017	27.07.2018	36 815 855	%	101.150	100.000	100.000		0.000	Y
8.34 % (7.9011 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.07.2017	27.07.2018	36 815 854	%	104.490	100.000	100.000		0.000	Y
4.38 % (4.1936 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.07.2017	27.07.2018	36 815 862	%	101.940	100.000	100.000		0.000	Y
9.89 % (9.4691 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.07.2017	27.07.2018	36 815 868	%	102.540	100.000	100.000		0.000	Y
4.61 % (4.4256 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.07.2017	27.07.2018	36 815 871	%	100.960	100.000	100.000		0.000	Y
8.09 % (7.7664 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.07.2017	27.07.2018	36 815 872	%	104.280	100.000	100.000		0.000	Y
6.77 % (6.4992 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.07.2017	27.07.2018	36 815 873	%	102.430	100.000	100.000		0.000	Y
7.22 % (6.9312 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.07.2017	27.07.2018	36 815 870	%	101.890	100.000	100.000		0.000	Y
7.67 % (7.3829 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.07.2017	27.07.2018	36 815 876	%	103.960	100.000	100.000		0.000	Y
5.15 % (5.0108 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.07.2017	27.07.2018	36 815 885	%	103.550	100.000	100.000		0.000	Y
5.59 % (5.4537 % p.a.) Reverse Convertible auf LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	18.07.2017	27.07.2018	36 815 888	%	99.020	100.000	100.000		0.000	Y
3.98 % (3.8935 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.07.2017	27.07.2018	36 815 894	%	101.290	100.000	100.000		0.000	Y
8.86 % (8.6674 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.07.2017	27.07.2018	36 815 895	%	100.360	100.000	100.000		0.000	Y
11.69 % (11.4359 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.07.2017	27.07.2018	36 815 897	%	100.570	100.000	100.000		0.000	Y
9.24 % (9.0391 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	10'000.00	19.07.2017	27.07.2018	36 815 896	%	100.830	100.000	100.000		0.000	Y
4.93 % (4.836 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.07.2017	27.07.2018	36 815 904	%	102.200	100.000	100.000		0.000	Y
3.01 % (2.9526 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.07.2017	27.07.2018	36 815 903	%	94.820	100.000	100.000		0.000	Y
15.29 % (15.0393 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.07.2017	27.07.2018	36 815 911	%	107.450	100.000	100.000		0.000	Y
4.33 % (4.259 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.07.2017	27.07.2018	36 815 908	%	99.500	100.000	100.000		0.000	Y
7.43 % (7.3082 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.07.2017	27.07.2018	36 815 907	%	103.460	100.000	100.000		0.000	Y
10.41 % (10.2393 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.07.2017	27.07.2018	36 815 905	%	101.410	100.000	100.000		0.000	Y
6.43 % (6.3945 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.07.2017	27.07.2018	36 815 916	%	102.800	100.000	100.000		0.000	Y
6.41 % (6.3746 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.07.2017	27.07.2018	36 815 914	%	101.870	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
9 % (8.9751 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.07.2017	27.07.2018	36 815 921	%	100.570	100.000	100.000		0.000	Y
4.43 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	27.07.2017	27.07.2018	36 815 926	%	100.150	100.000	100.000		0.000	Y
8.03 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.07.2017	27.07.2018	36 815 924	%	103.050	100.000	100.000		0.000	Y
5.12 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.07.2017	27.07.2018	36 815 925	%	101.530	100.000	100.000		0.000	Y
7.65 % (7.6713 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.07.2017	27.07.2018	36 815 928	%	99.210	100.000	100.000		0.000	Y
5.3 % (6.3389 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.09.2017	27.07.2018	36 816 254	%	94.500	100.000	100.000		0.000	Y
5.73 % (9.2502 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.12.2017	27.07.2018	36 816 820	%	98.160	100.000	100.000		0.000	Y
3.81 % (6.5314 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.12.2017	27.07.2018	36 816 892	%	98.290	100.000	100.000		0.000	Y
3.18 % (3.1624 % p.a.) Reverse Convertible auf Geberit N	CHF	1'000.00	28.07.2017	30.07.2018	36 815 932	%	98.840	100.000	100.000		0.000	Y
2.7 % (1.8 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.01.2017	31.07.2018	34 414 469	%	101.830	100.000	100.000		0.000	Y
9.66 % (9.4757 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.07.2017	02.08.2018	36 815 920	%	101.850	100.000	100.000		0.000	Y
9.62 % (8.9488 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.07.2017	03.08.2018	36 815 848	%	105.360	100.000	100.000		0.000	Y
9.93 % (9.0273 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.06.2017	06.08.2018	36 815 821	%	105.040	100.000	100.000		0.000	Y
7.67 % (7.6276 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.08.2017	06.08.2018	36 815 950	%	102.160	100.000	100.000		0.000	Y
5.51 % (5.4796 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	04.08.2017	06.08.2018	36 815 949	%	103.800	100.000	100.000		0.000	Y
7.74 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.08.2017	07.08.2018	36 815 963	%	103.790	100.000	100.000		0.000	Y
9.66 % (9.0563 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.07.2017	08.08.2018	36 815 881	%	103.650	100.000	100.000		0.000	Y
9.55 % (9.2919 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.07.2017	08.08.2018	36 815 929	%	102.950	100.000	100.000		0.000	Y
9.81 % (9.7828 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.08.2017	08.08.2018	36 815 964	%	104.320	100.000	100.000		0.000	Y
8.22 % (8.781 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.09.2017	08.08.2018	36 816 118	%	103.180	100.000	100.000		0.000	Y
7.28 % (7.3825 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.08.2017	09.08.2018	36 815 993	%	98.630	100.000	100.000		0.000	Y
5.21 % (5.1812 % p.a.) Reverse Convertible auf ams I	CHF	1'000.00	11.08.2017	13.08.2018	36 815 989	%	101.340	100.000	100.000		0.000	Y
4.15 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.08.2017	14.08.2018	36 815 994	%	100.220	100.000	100.000		0.000	Y
5.51 % Reverse Convertible auf ams I	CHF	1'000.00	14.08.2017	14.08.2018	36 815 995	%	100.900	100.000	100.000		0.000	Y
6.83 % (5.0593 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.04.2017	17.08.2018	34 415 103	%	105.480	100.000	100.000		0.000	Y
5.79 % (5.758 % p.a.) Reverse Convertible auf ams I	CHF	1'000.00	18.08.2017	20.08.2018	36 816 024	%	101.710	100.000	100.000		0.000	Y
5.45 % Reverse Convertible auf ams I	CHF	1'000.00	21.08.2017	21.08.2018	36 816 032	%	101.000	100.000	100.000		0.000	Y
5.45 % Reverse Convertible auf ams I	CHF	1'000.00	21.08.2017	21.08.2018	36 816 031	%	101.000	100.000	100.000		0.000	Y
5.51 % Reverse Convertible auf ams I	CHF	1'000.00	23.08.2017	23.08.2018	36 816 054	%	100.840	100.000	100.000		0.000	Y
17.74 % (8.7605 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.08.2016	24.08.2018	32 771 362	%	116.000	100.000	100.000		0.000	Y
12.09 % (6.0366 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.08.2016	24.08.2018	32 771 411	%	110.980	100.000	100.000		0.000	Y
9.53 % (6.1046 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.02.2017	24.08.2018	34 414 499	%	91.040	100.000	100.000		0.000	Y
8.59 % (5.6123 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.02.2017	24.08.2018	34 414 603	%	107.490	100.000	100.000		0.000	Y
7.85 % (5.1569 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	16.02.2017	24.08.2018	34 414 649	%	106.270	100.000	100.000		0.000	Y
8.82 % (5.8368 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	20.02.2017	24.08.2018	34 414 682	%	106.820	100.000	100.000		0.000	Y
7.69 % (5.1077 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	22.02.2017	24.08.2018	34 414 716	%	106.830	100.000	100.000		0.000	Y
3.46 % (2.6446 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.05.2017	24.08.2018	34 415 233	%	100.750	100.000	100.000		0.000	Y
10.7 % (10.0838 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.08.2017	24.08.2018	36 815 938	%	102.080	100.000	100.000		0.000	Y
5.12 % (4.8251 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.08.2017	24.08.2018	36 815 942	%	100.580	100.000	100.000		0.000	Y
5.8 % (5.4947 % p.a.) Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	5'000.00	04.08.2017	24.08.2018	36 815 948	%	98.640	100.000	100.000		0.000	Y
11.91 % (11.2832 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.08.2017	24.08.2018	36 815 951	%	99.370	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
6.07 % (5.7963 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.08.2017	24.08.2018	36 815 956	%	102.880	100.000	100.000		0.000	Y
9.41 % (9.0578 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.08.2017	24.08.2018	36 815 979	%	101.780	100.000	100.000		0.000	Y
9.45 % (9.1206 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.08.2017	24.08.2018	36 815 981	%	103.270	100.000	100.000		0.000	Y
5.98 % (5.7716 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.08.2017	24.08.2018	36 815 983	%	103.890	100.000	100.000		0.000	Y
4.61 % (4.4493 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.08.2017	24.08.2018	36 815 991	%	101.130	100.000	100.000		0.000	Y
6.25 % (6.0322 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.08.2017	24.08.2018	36 815 984	%	96.090	100.000	100.000		0.000	Y
5.72 % (5.5654 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.08.2017	24.08.2018	36 816 002	%	101.950	100.000	100.000		0.000	Y
3.89 % (3.7849 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	14.08.2017	24.08.2018	36 815 996	%	100.410	100.000	100.000		0.000	Y
5.64 % (5.5024 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.08.2017	24.08.2018	36 816 003	%	99.130	100.000	100.000		0.000	Y
8.21 % (8.0098 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	15.08.2017	24.08.2018	36 816 006	%	106.830	100.000	100.000		0.000	Y
4.74 % (4.6244 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.08.2017	24.08.2018	36 816 010	%	82.430	100.000	100.000		0.000	Y
8.31 % (8.1073 % p.a.) Reverse Convertible auf Tesla Rg	CHF	1'000.00	15.08.2017	24.08.2018	36 816 008	%	94.590	100.000	100.000		0.000	Y
3.24 % (3.1696 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.08.2017	24.08.2018	36 816 013	%	100.660	100.000	100.000		0.000	Y
3.8 % (3.7174 % p.a.) Reverse Convertible auf Georg Fischer N	CHF	5'000.00	16.08.2017	24.08.2018	36 816 018	%	102.490	100.000	100.000		0.000	Y
4 % (3.913 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.08.2017	24.08.2018	36 816 012	%	99.650	100.000	100.000		0.000	Y
4.88 % (4.7869 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	17.08.2017	24.08.2018	36 816 021	%	99.740	100.000	100.000		0.000	Y
5.96 % (5.8623 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	18.08.2017	24.08.2018	36 816 029	%	102.270	100.000	100.000		0.000	Y
3.07 % (3.0197 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.08.2017	24.08.2018	36 816 030	%	101.410	100.000	100.000		0.000	Y
9.3 % (9.1475 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.08.2017	24.08.2018	36 816 025	%	106.050	100.000	100.000		0.000	Y
6.29 % (6.238 % p.a.) Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	1'000.00	21.08.2017	24.08.2018	36 816 035	%	99.670	100.000	100.000		0.000	Y
6.11 % (6.0595 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.08.2017	24.08.2018	36 816 034	%	102.580	100.000	100.000		0.000	Y
5.68 % (5.6486 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.08.2017	24.08.2018	36 816 040	%	95.540	100.000	100.000		0.000	Y
7.81 % (7.7669 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.08.2017	24.08.2018	36 816 043	%	103.620	100.000	100.000		0.000	Y
5.89 % (5.8575 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	22.08.2017	24.08.2018	36 816 041	%	101.730	100.000	100.000		0.000	Y
6.49 % (6.472 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	23.08.2017	24.08.2018	36 816 052	%	98.540	100.000	100.000		0.000	Y
4.19 % (4.1784 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.08.2017	24.08.2018	36 816 055	%	99.370	100.000	100.000		0.000	Y
3.52 % (3.5102 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.08.2017	24.08.2018	36 816 049	%	99.340	100.000	100.000		0.000	Y
7.17 % (7.1501 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.08.2017	24.08.2018	36 816 045	%	100.860	100.000	100.000		0.000	Y
4.74 % (4.7269 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.08.2017	24.08.2018	36 816 051	%	72.950	100.000	100.000		0.000	Y
5.44 % Reverse Convertible auf Tesla Rg	CHF	1'000.00	24.08.2017	24.08.2018	36 816 061	%	96.710	100.000	100.000		0.000	Y
9.25 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.08.2017	24.08.2018	36 816 060	%	95.300	100.000	100.000		0.000	Y
6.83 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	24.08.2017	24.08.2018	36 816 062	%	98.820	100.000	100.000		0.000	Y
6.9 % (7.0169 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.08.2017	24.08.2018	36 816 101	%	103.630	100.000	100.000		0.000	Y
3.4 % (4.2062 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.11.2017	24.08.2018	36 816 513	%	98.830	100.000	100.000		0.000	Y
6.37 % (8.2489 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	16.11.2017	24.08.2018	36 816 618	%	100.700	100.000	100.000		0.000	Y
4.95 % (3.2818 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.02.2017	27.08.2018	34 414 750	%	103.980	100.000	100.000		0.000	Y
5.77 % (5.7381 % p.a.) Reverse Convertible auf ams I	CHF	1'000.00	25.08.2017	27.08.2018	36 816 066	%	101.560	100.000	100.000		0.000	Y
3.22 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.08.2017	28.08.2018	36 816 075	%	99.650	100.000	100.000		0.000	Y
3.45 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.08.2017	28.08.2018	36 816 073	%	98.640	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.08.2017	28.08.2018	36 816 071	%	99.740	100.000	100.000		0.000	Y
5.89 % (3.8764 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.02.2017	29.08.2018	34 414 717	%	103.980	100.000	100.000		0.000	Y
5.89 % Reverse Convertible auf ams I	CHF	1'000.00	30.08.2017	30.08.2018	36 816 102	%	100.730	100.000	100.000		0.000	Y
5.5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.09.2017	05.09.2018	36 816 126	%	102.870	100.000	100.000		0.000	Y
2.18 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.09.2017	05.09.2018	36 816 132	%	100.660	100.000	100.000		0.000	Y
7.12 % Reverse Convertible auf ams I	CHF	1'000.00	05.09.2017	05.09.2018	36 816 133	%	102.120	100.000	100.000		0.000	Y
2.58 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	05.09.2017	05.09.2018	36 816 128	%	99.060	100.000	100.000		0.000	Y
4.5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.09.2017	07.09.2018	36 816 151	%	99.830	100.000	100.000		0.000	Y
5.15 % Reverse Convertible auf ams I	CHF	1'000.00	12.09.2017	12.09.2018	36 816 169	%	99.110	100.000	100.000		0.000	Y
3.83 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	13.09.2017	13.09.2018	36 816 176	%	101.420	100.000	100.000		0.000	Y
4.04 % Reverse Convertible auf Carrefour	CHF	1'000.00	20.09.2017	20.09.2018	36 816 214	%	100.960	100.000	100.000		0.000	Y
4.58 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.09.2017	20.09.2018	36 816 215	%	101.290	100.000	100.000		0.000	Y
3.2 % (3.0557 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.09.2017	21.09.2018	36 816 123	%	99.730	100.000	100.000		0.000	Y
4.05 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.09.2017	21.09.2018	36 816 226	%	96.530	100.000	100.000		0.000	Y
5.79 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.09.2017	25.09.2018	36 816 245	%	102.240	100.000	100.000		0.000	Y
3.1 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.09.2017	26.09.2018	36 816 261	%	98.790	100.000	100.000		0.000	Y
4.6 % Reverse Convertible auf ams I	CHF	1'000.00	27.09.2017	27.09.2018	36 816 269	%	96.660	100.000	100.000		0.000	Y
7.63 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.09.2017	27.09.2018	36 816 272	%	99.440	100.000	100.000		0.000	Y
3.93 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.09.2017	27.09.2018	36 816 270	%	100.020	100.000	100.000		0.000	Y
4.79 % Reverse Convertible auf ams I	CHF	1'000.00	27.09.2017	27.09.2018	36 816 271	%	96.790	100.000	100.000		0.000	Y
9.29 % (5.8984 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.03.2017	28.09.2018	34 414 775	%	106.970	100.000	100.000		0.000	Y
14 % (8.9204 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.03.2017	28.09.2018	34 414 818	%	111.890	100.000	100.000		0.000	Y
6.42 % (4.233 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.03.2017	28.09.2018	34 414 959	%	103.370	100.000	100.000		0.000	Y
6.3 % (5.04 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.06.2017	28.09.2018	36 815 801	%	103.450	100.000	100.000		0.000	Y
9.01 % (7.7045 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	27.07.2017	28.09.2018	36 815 923	%	102.430	100.000	100.000		0.000	Y
5.55 % (4.8971 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.08.2017	28.09.2018	36 815 977	%	99.980	100.000	100.000		0.000	Y
11.12 % (10.1347 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.08.2017	28.09.2018	36 816 053	%	101.170	100.000	100.000		0.000	Y
5.96 % (5.4595 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.08.2017	28.09.2018	36 816 067	%	99.330	100.000	100.000		0.000	Y
7.35 % (6.7328 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.08.2017	28.09.2018	36 816 068	%	100.820	100.000	100.000		0.000	Y
5.47 % (5.0492 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.08.2017	28.09.2018	36 816 077	%	102.600	100.000	100.000		0.000	Y
5.94 % (5.4972 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.08.2017	28.09.2018	36 816 087	%	96.600	100.000	100.000		0.000	Y
4.4 % (4.0825 % p.a.) Reverse Convertible auf Vifor Pharma N	CHF	1'000.00	30.08.2017	28.09.2018	36 816 093	%	103.340	100.000	100.000		0.000	Y
11.85 % (10.9948 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.08.2017	28.09.2018	36 816 099	%	100.480	100.000	100.000		0.000	Y
2.3 % (2.134 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.08.2017	28.09.2018	36 816 090	%	101.240	100.000	100.000		0.000	Y
3.82 % (3.5443 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.08.2017	28.09.2018	36 816 104	%	94.970	100.000	100.000		0.000	Y
8.23 % (7.6361 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.08.2017	28.09.2018	36 816 108	%	99.960	100.000	100.000		0.000	Y
4.72 % (4.3794 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.08.2017	28.09.2018	36 816 105	%	99.770	100.000	100.000		0.000	Y
9.3 % (8.6512 % p.a.) Reverse Convertible auf ams I	CHF	1'000.00	01.09.2017	28.09.2018	36 816 116	%	105.200	100.000	100.000		0.000	Y
5.39 % (5.014 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.09.2017	28.09.2018	36 816 113	%	102.110	100.000	100.000		0.000	Y
4.3 % (4 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.09.2017	28.09.2018	36 816 112	%	98.840	100.000	100.000		0.000	Y
7.05 % (6.5581 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.09.2017	28.09.2018	36 816 111	%	102.000	100.000	100.000		0.000	Y
13.57 % (12.6233 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.09.2017	28.09.2018	36 816 117	%	95.600	100.000	100.000		0.000	Y
7.78 % (7.2938 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.09.2017	28.09.2018	36 816 121	%	102.210	100.000	100.000		0.000	Y
6.94 % (6.5232 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	05.09.2017	28.09.2018	36 816 127	%	100.670	100.000	100.000		0.000	Y
9.21 % (8.6569 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.09.2017	28.09.2018	36 816 135	%	101.940	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
7.62 % (7.1812 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.09.2017	28.09.2018	36 816 143	%	101.790	100.000	100.000		0.000	Y
5.21 % (4.9099 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.09.2017	28.09.2018	36 816 140	%	99.860	100.000	100.000		0.000	Y
11.71 % (11.0356 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.09.2017	28.09.2018	36 816 139	%	101.290	100.000	100.000		0.000	Y
5.37 % (5.0607 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.09.2017	28.09.2018	36 816 142	%	100.170	100.000	100.000		0.000	Y
10.54 % (9.9591 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.09.2017	28.09.2018	36 816 146	%	100.410	100.000	100.000		0.000	Y
5.39 % (5.0929 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.09.2017	28.09.2018	36 816 147	%	100.960	100.000	100.000		0.000	Y
5.89 % (5.5654 % p.a.) Reverse Convertible auf Carrefour	CHF	1'000.00	07.09.2017	28.09.2018	36 816 148	%	103.230	100.000	100.000		0.000	Y
5.2 % (4.9134 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.09.2017	28.09.2018	36 816 144	%	103.060	100.000	100.000		0.000	Y
5.57 % (5.2768 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.09.2017	28.09.2018	36 816 153	%	100.140	100.000	100.000		0.000	Y
5.17 % (4.8979 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.09.2017	28.09.2018	36 816 157	%	100.990	100.000	100.000		0.000	Y
8.56 % (8.1095 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.09.2017	28.09.2018	36 816 159	%	105.200	100.000	100.000		0.000	Y
6.8 % (6.4934 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.09.2017	28.09.2018	36 816 163	%	103.390	100.000	100.000		0.000	Y
10.38 % (9.9383 % p.a.) Reverse Convertible auf u-blox Hldg N	CHF	1'000.00	12.09.2017	28.09.2018	36 816 166	%	105.430	100.000	100.000		0.000	Y
3.72 % (3.5617 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.09.2017	28.09.2018	36 816 168	%	101.320	100.000	100.000		0.000	Y
8.36 % (8.0043 % p.a.) Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	1'000.00	12.09.2017	28.09.2018	36 816 165	%	98.940	100.000	100.000		0.000	Y
7.21 % (6.9216 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.09.2017	28.09.2018	36 816 173	%	102.900	100.000	100.000		0.000	Y
8.44 % (8.1024 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.09.2017	28.09.2018	36 816 180	%	101.830	100.000	100.000		0.000	Y
4.6 % (4.4397 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.09.2017	28.09.2018	36 816 191	%	98.380	100.000	100.000		0.000	Y
8.49 % (8.1941 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.09.2017	28.09.2018	36 816 189	%	99.680	100.000	100.000		0.000	Y
8.45 % (8.1555 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.09.2017	28.09.2018	36 816 188	%	99.550	100.000	100.000		0.000	Y
5.24 % (5.0984 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.09.2017	28.09.2018	36 816 193	%	100.430	100.000	100.000		0.000	Y
4.25 % (4.1463 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.09.2017	28.09.2018	36 816 201	%	98.740	100.000	100.000		0.000	Y
7.14 % (6.9848 % p.a.) Reverse Convertible auf ams I	CHF	1'000.00	20.09.2017	28.09.2018	36 816 206	%	98.580	100.000	100.000		0.000	Y
6.2 % (6.0652 % p.a.) Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	1'000.00	20.09.2017	28.09.2018	36 816 207	%	95.790	100.000	100.000		0.000	Y
5.87 % (5.7424 % p.a.) Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	1'000.00	20.09.2017	28.09.2018	36 816 216	%	97.730	100.000	100.000		0.000	Y
5.74 % (5.6305 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	21.09.2017	28.09.2018	36 816 221	%	99.360	100.000	100.000		0.000	Y
7.18 % (7.0431 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.09.2017	28.09.2018	36 816 223	%	100.040	100.000	100.000		0.000	Y
4.33 % (4.2474 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.09.2017	28.09.2018	36 816 227	%	98.640	100.000	100.000		0.000	Y
5.66 % (5.5672 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.09.2017	28.09.2018	36 816 235	%	98.040	100.000	100.000		0.000	Y
5.97 % (5.8721 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.09.2017	28.09.2018	36 816 237	%	96.500	100.000	100.000		0.000	Y
6.01 % (5.9115 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.09.2017	28.09.2018	36 816 236	%	100.240	100.000	100.000		0.000	Y
4.99 % (4.9082 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.09.2017	28.09.2018	36 816 233	%	101.000	100.000	100.000		0.000	Y
9.28 % (9.2033 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.09.2017	28.09.2018	36 816 249	%	92.680	100.000	100.000		0.000	Y
9.55 % (9.4711 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.09.2017	28.09.2018	36 816 241	%	93.770	100.000	100.000		0.000	Y
5.27 % (5.2409 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.09.2017	28.09.2018	36 816 259	%	99.780	100.000	100.000		0.000	Y
7.51 % (7.4685 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.09.2017	28.09.2018	36 816 255	%	98.730	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4.21 % (4.1867 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.09.2017	28.09.2018	36 816 252	%	98.770	100.000	100.000		0.000	Y
4.21 % (4.1867 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.09.2017	28.09.2018	36 816 253	%	98.780	100.000	100.000		0.000	Y
9.29 % (9.2387 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.09.2017	28.09.2018	36 816 251	%	92.730	100.000	100.000		0.000	Y
6.09 % (6.0731 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.09.2017	28.09.2018	36 816 266	%	97.930	100.000	100.000		0.000	Y
4.91 % (4.8964 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.09.2017	28.09.2018	36 816 273	%	98.770	100.000	100.000		0.000	Y
5.85 % (5.8338 % p.a.) Reverse Convertible auf Halliburton Rg	CHF	1'000.00	27.09.2017	28.09.2018	36 816 276	%	101.990	100.000	100.000		0.000	Y
4.91 % (4.8964 % p.a.) Reverse Convertible auf Linde I	CHF	1'000.00	27.09.2017	28.09.2018	36 816 275	%	101.890	100.000	100.000		0.000	Y
6.57 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	28.09.2017	28.09.2018	36 816 280	%	93.110	100.000	100.000		0.000	Y
11.05 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.09.2017	28.09.2018	36 816 279	%	102.010	100.000	100.000		0.000	Y
3.69 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.09.2017	28.09.2018	36 816 281	%	101.000	100.000	100.000		0.000	Y
4.43 % Reverse Convertible auf Cie Financiere Richemont	CHF	1'000.00	28.09.2017	28.09.2018	36 816 288	%	98.960	100.000	100.000		0.000	Y
2.2 % Reverse Convertible auf Novartis N	CHF	1'000.00	28.09.2017	28.09.2018	36 816 292	%	97.470	100.000	100.000		0.000	Y
3.07 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.09.2017	28.09.2018	36 816 285	%	97.910	100.000	100.000		0.000	Y
3.09 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.09.2017	28.09.2018	36 816 284	%	96.780	100.000	100.000		0.000	Y
4.66 % (4.8207 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	10.10.2017	28.09.2018	36 816 354	%	97.140	100.000	100.000		0.000	Y
4.71 % (4.9148 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.10.2017	28.09.2018	36 816 390	%	96.760	100.000	100.000		0.000	Y
7.09 % (7.7112 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.10.2017	28.09.2018	36 816 451	%	97.980	100.000	100.000		0.000	Y
3.37 % (3.876 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.11.2017	28.09.2018	36 816 613	%	96.200	100.000	100.000		0.000	Y
3.51 % (4.0371 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.11.2017	28.09.2018	36 816 612	%	97.840	100.000	100.000		0.000	Y
7.6 % (8.9412 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.11.2017	28.09.2018	36 816 647	%	98.620	100.000	100.000		0.000	Y
9.51 % (9.4314 % p.a.) Reverse Convertible auf Tesla Rg	CHF	1'000.00	28.09.2017	01.10.2018	36 816 291	%	93.090	100.000	100.000		0.000	Y
4.78 % (4.7536 % p.a.) Reverse Convertible auf Logitech Intl N	CHF	1'000.00	29.09.2017	01.10.2018	36 816 294	%	96.670	100.000	100.000		0.000	Y
4.11 % (4.133 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.10.2017	04.10.2018	36 816 315	%	100.290	100.000	100.000		0.000	Y
4.8 % (4.7603 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.10.2017	05.10.2018	36 816 303	%	98.300	100.000	100.000		0.000	Y
3.64 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.10.2017	05.10.2018	36 816 329	%	97.360	100.000	100.000		0.000	Y
7.76 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	05.10.2017	05.10.2018	36 816 328	%	98.510	100.000	100.000		0.000	Y
6.36 % (6.4315 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.10.2017	05.10.2018	36 816 350	%	96.570	100.000	100.000		0.000	Y
4.26 % (4.2365 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.10.2017	08.10.2018	36 816 346	%	100.480	100.000	100.000		0.000	Y
6.21 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.10.2017	10.10.2018	36 816 359	%	97.930	100.000	100.000		0.000	Y
6.46 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.10.2017	10.10.2018	36 816 361	%	100.300	100.000	100.000		0.000	Y
4.56 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.10.2017	11.10.2018	36 816 372	%	100.600	100.000	100.000		0.000	Y
4.5 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.10.2017	11.10.2018	36 816 367	%	100.520	100.000	100.000		0.000	Y
4.03 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.10.2017	11.10.2018	36 816 363	%	99.980	100.000	100.000		0.000	Y
10.28 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	12.10.2017	12.10.2018	36 816 375	%	94.680	100.000	100.000		0.000	Y
6.53 % (4.3695 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.04.2017	17.10.2018	34 415 122	%	103.070	100.000	100.000		0.000	Y
4.25 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.10.2017	17.10.2018	36 816 399	%	98.620	100.000	100.000		0.000	Y
4.14 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.10.2017	17.10.2018	36 816 400	%	98.510	100.000	100.000		0.000	Y
3.03 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.10.2017	18.10.2018	36 816 406	%	97.900	100.000	100.000		0.000	Y
6.39 % (5.1007 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.07.2017	22.10.2018	36 815 910	%	101.350	100.000	100.000		0.000	Y
4.35 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.10.2017	23.10.2018	36 816 428	%	96.810	100.000	100.000		0.000	Y
3.05 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.10.2017	24.10.2018	36 816 435	%	97.810	100.000	100.000		0.000	Y
11.22 % (5.5945 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.10.2016	26.10.2018	32 771 838	%	108.700	100.000	100.000		0.000	Y
6.38 % (3.1856 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.10.2016	26.10.2018	32 771 845	%	105.280	100.000	100.000		0.000	Y
9.18 % (5.8389 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.03.2017	26.10.2018	34 415 030	%	104.800	100.000	100.000		0.000	Y
14.2 % (9.0318 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.03.2017	26.10.2018	34 415 037	%	111.770	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
6.66 % (5.8621 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.09.2017	26.10.2018	36 816 150	%	99.990	100.000	100.000		0.000	Y
6.66 % (5.8765 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.09.2017	26.10.2018	36 816 152	%	99.990	100.000	100.000		0.000	Y
6.77 % (6.0476 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.09.2017	26.10.2018	36 816 179	%	100.490	100.000	100.000		0.000	Y
16.65 % (15.0603 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.09.2017	26.10.2018	36 816 192	%	97.680	100.000	100.000		0.000	Y
8.64 % (7.8545 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.09.2017	26.10.2018	36 816 205	%	100.510	100.000	100.000		0.000	Y
4.89 % (4.5488 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.09.2017	26.10.2018	36 816 293	%	97.940	100.000	100.000		0.000	Y
5.11 % (4.7535 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.09.2017	26.10.2018	36 816 300	%	98.710	100.000	100.000		0.000	Y
5.41 % (5.0326 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.09.2017	26.10.2018	36 816 301	%	98.460	100.000	100.000		0.000	Y
4.36 % (4.0558 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.09.2017	26.10.2018	36 816 302	%	98.700	100.000	100.000		0.000	Y
5.32 % (4.9488 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.09.2017	26.10.2018	36 816 295	%	96.210	100.000	100.000		0.000	Y
5.58 % (5.1907 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.09.2017	26.10.2018	36 816 297	%	98.050	100.000	100.000		0.000	Y
5.12 % (4.8125 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.10.2017	26.10.2018	36 816 310	%	99.500	100.000	100.000		0.000	Y
5.78 % (5.4329 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.10.2017	26.10.2018	36 816 308	%	99.830	100.000	100.000		0.000	Y
5.65 % (5.3107 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.10.2017	26.10.2018	36 816 307	%	97.890	100.000	100.000		0.000	Y
9.03 % (8.5099 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.10.2017	26.10.2018	36 816 319	%	100.290	100.000	100.000		0.000	Y
4.65 % (4.3822 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.10.2017	26.10.2018	36 816 321	%	100.040	100.000	100.000		0.000	Y
6.78 % (6.3895 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.10.2017	26.10.2018	36 816 322	%	102.400	100.000	100.000		0.000	Y
5.47 % (5.155 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.10.2017	26.10.2018	36 816 323	%	96.630	100.000	100.000		0.000	Y
4.95 % (4.6772 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.10.2017	26.10.2018	36 816 340	%	99.130	100.000	100.000		0.000	Y
6.17 % (5.8299 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.10.2017	26.10.2018	36 816 332	%	95.070	100.000	100.000		0.000	Y
4.32 % (4.0819 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.10.2017	26.10.2018	36 816 331	%	99.900	100.000	100.000		0.000	Y
5.26 % (4.9701 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.10.2017	26.10.2018	36 816 341	%	94.730	100.000	100.000		0.000	Y
5.52 % (5.2157 % p.a.) Reverse Convertible auf Tesla Rg	CHF	1'000.00	05.10.2017	26.10.2018	36 816 339	%	95.750	100.000	100.000		0.000	Y
5.93 % (5.6179 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.10.2017	26.10.2018	36 816 345	%	97.860	100.000	100.000		0.000	Y
3.02 % (2.8611 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.10.2017	26.10.2018	36 816 343	%	98.900	100.000	100.000		0.000	Y
4.54 % (4.3353 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	09.10.2017	26.10.2018	36 816 349	%	99.470	100.000	100.000		0.000	Y
4.42 % (4.2207 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	09.10.2017	26.10.2018	36 816 351	%	99.490	100.000	100.000		0.000	Y
8.88 % (8.5021 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.10.2017	26.10.2018	36 816 357	%	91.460	100.000	100.000		0.000	Y
4.65 % (4.4521 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.10.2017	26.10.2018	36 816 360	%	96.640	100.000	100.000		0.000	Y
5.47 % (5.2372 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.10.2017	26.10.2018	36 816 358	%	92.360	100.000	100.000		0.000	Y
4.23 % (4.0608 % p.a.) Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	11.10.2017	26.10.2018	36 816 368	%	96.870	100.000	100.000		0.000	Y
9.41 % (9.0336 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.10.2017	26.10.2018	36 816 369	%	96.790	100.000	100.000		0.000	Y
3.11 % (2.9936 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.10.2017	26.10.2018	36 816 377	%	98.710	100.000	100.000		0.000	Y
6.8 % (6.5455 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.10.2017	26.10.2018	36 816 384	%	99.180	100.000	100.000		0.000	Y
4.27 % (4.1102 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.10.2017	26.10.2018	36 816 382	%	97.390	100.000	100.000		0.000	Y
6.68 % (6.4299 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.10.2017	26.10.2018	36 816 383	%	97.760	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4.05 % (3.8984 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.10.2017	26.10.2018	36 816 378	%	96.670	100.000	100.000		0.000	Y
4.16 % (4.0043 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.10.2017	26.10.2018	36 816 381	%	99.080	100.000	100.000		0.000	Y
4.27 % (4.1102 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.10.2017	26.10.2018	36 816 379	%	97.380	100.000	100.000		0.000	Y
4.16 % (4.0043 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.10.2017	26.10.2018	36 816 380	%	99.080	100.000	100.000		0.000	Y
5.25 % (5.0535 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.10.2017	26.10.2018	36 816 373	%	98.190	100.000	100.000		0.000	Y
5.27 % (5.0727 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.10.2017	26.10.2018	36 816 374	%	97.480	100.000	100.000		0.000	Y
3.7 % (3.571 % p.a.) Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	13.10.2017	26.10.2018	36 816 392	%	99.220	100.000	100.000		0.000	Y
9.39 % (9.1362 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.10.2017	26.10.2018	36 816 394	%	93.180	100.000	100.000		0.000	Y
6.37 % (6.1978 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.10.2017	26.10.2018	36 816 396	%	96.620	100.000	100.000		0.000	Y
3.77 % (3.6681 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.10.2017	26.10.2018	36 816 395	%	96.770	100.000	100.000		0.000	Y
8.93 % (8.7122 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.10.2017	26.10.2018	36 816 401	%	97.810	100.000	100.000		0.000	Y
6.11 % (5.961 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	17.10.2017	26.10.2018	36 816 402	%	99.870	100.000	100.000		0.000	Y
3.73 % (3.6489 % p.a.) Reverse Convertible auf LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	18.10.2017	26.10.2018	36 816 407	%	97.440	100.000	100.000		0.000	Y
7.33 % (7.1707 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.10.2017	26.10.2018	36 816 404	%	97.220	100.000	100.000		0.000	Y
5.66 % (5.552 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.10.2017	26.10.2018	36 816 417	%	98.340	100.000	100.000		0.000	Y
4.85 % (4.7575 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.10.2017	26.10.2018	36 816 419	%	97.830	100.000	100.000		0.000	Y
5.3 % (5.1989 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.10.2017	26.10.2018	36 816 413	%	96.680	100.000	100.000		0.000	Y
6.58 % (6.4721 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.10.2017	26.10.2018	36 816 420	%	89.190	100.000	100.000		0.000	Y
11.27 % (11.0852 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.10.2017	26.10.2018	36 816 423	%	96.330	100.000	100.000		0.000	Y
4.06 % (4.0264 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.10.2017	26.10.2018	36 816 426	%	97.270	100.000	100.000		0.000	Y
4.86 % (4.8331 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.10.2017	26.10.2018	36 816 434	%	99.250	100.000	100.000		0.000	Y
4.87 % (4.8431 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.10.2017	26.10.2018	36 816 433	%	99.250	100.000	100.000		0.000	Y
5.16 % (5.1315 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.10.2017	26.10.2018	36 816 432	%	100.910	100.000	100.000		0.000	Y
5.22 % (5.2055 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	25.10.2017	26.10.2018	36 816 444	%	96.280	100.000	100.000		0.000	Y
3.01 % (3.0017 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.10.2017	26.10.2018	36 816 443	%	97.390	100.000	100.000		0.000	Y
6.38 % (6.3623 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.10.2017	26.10.2018	36 816 441	%	93.340	100.000	100.000		0.000	Y
5.39 % (5.3751 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.10.2017	26.10.2018	36 816 438	%	97.860	100.000	100.000		0.000	Y
3.68 % (3.6698 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.10.2017	26.10.2018	36 816 439	%	98.210	100.000	100.000		0.000	Y
7.3 % (7.2798 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.10.2017	26.10.2018	36 816 440	%	97.210	100.000	100.000		0.000	Y
9.45 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.10.2017	26.10.2018	36 816 448	%	92.270	100.000	100.000		0.000	Y
6.89 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.10.2017	26.10.2018	36 816 447	%	99.270	100.000	100.000		0.000	Y
5.63 % (5.7093 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.11.2017	26.10.2018	36 816 494	%	99.260	100.000	100.000		0.000	Y
10.1 % (9.2992 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	28.09.2017	29.10.2018	36 816 283	%	99.990	100.000	100.000		0.000	Y
3.24 % (3.2221 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.10.2017	29.10.2018	36 816 454	%	96.480	100.000	100.000		0.000	Y
6.09 % (6.0564 % p.a.) Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	27.10.2017	29.10.2018	36 816 455	%	101.580	100.000	100.000		0.000	Y
4.43 % (4.4055 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.10.2017	29.10.2018	36 816 458	%	99.130	100.000	100.000		0.000	Y
4.92 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	31.10.2017	31.10.2018	36 816 481	%	95.950	100.000	100.000		0.000	Y
5.18 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	31.10.2017	31.10.2018	36 816 480	%	92.760	100.000	100.000		0.000	Y
4.63 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.11.2017	01.11.2018	36 816 495	%	98.280	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4.05 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.11.2017	01.11.2018	36 816 486	%	96.350	100.000	100.000		0.000	Y
5.36 % (5.3304 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.11.2017	05.11.2018	36 816 511	%	88.960	100.000	100.000		0.000	Y
3.06 % (3.0431 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.11.2017	05.11.2018	36 816 512	%	91.460	100.000	100.000		0.000	Y
9.6 % (9.547 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.11.2017	05.11.2018	36 816 506	%	91.740	100.000	100.000		0.000	Y
4.33 % (4.3061 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.11.2017	05.11.2018	36 816 503	%	99.180	100.000	100.000		0.000	Y
7.86 % (6.9867 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.09.2017	06.11.2018	36 816 222	%	102.800	100.000	100.000		0.000	Y
5.3 % (5.061 % p.a.) Reverse Convertible auf Sunrise Comm Gr N	CHF	1'000.00	20.10.2017	07.11.2018	36 816 422	%	101.650	100.000	100.000		0.000	Y
9.33 % (6.22 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.05.2017	09.11.2018	34 415 295	%	104.100	100.000	100.000		0.000	Y
5.89 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.11.2017	09.11.2018	36 816 559	%	96.880	100.000	100.000		0.000	Y
5.14 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.11.2017	14.11.2018	36 816 592	%	98.160	100.000	100.000		0.000	Y
8.14 % (4.0587 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.11.2016	19.11.2018	32 772 046	%	106.030	100.000	100.000		0.000	Y
7.27 % (4.8467 % p.a.) Reverse Convertible auf Vifor Pharma N	CHF	1'000.00	19.05.2017	19.11.2018	34 415 371	%	102.090	100.000	100.000		0.000	Y
5.73 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.11.2017	22.11.2018	36 816 650	%	97.190	100.000	100.000		0.000	Y
3.73 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.11.2017	22.11.2018	36 816 653	%	97.150	100.000	100.000		0.000	Y
6.37 % (3.0947 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.11.2016	23.11.2018	32 771 930	%	105.190	100.000	100.000		0.000	Y
8.63 % (4.303 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.11.2016	23.11.2018	32 772 063	%	107.110	100.000	100.000		0.000	Y
5.62 % (3.7467 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.05.2017	23.11.2018	34 415 378	%	99.180	100.000	100.000		0.000	Y
9.77 % (8.3544 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.09.2017	23.11.2018	36 816 239	%	99.840	100.000	100.000		0.000	Y
4.22 % (3.9358 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.10.2017	23.11.2018	36 816 452	%	98.390	100.000	100.000		0.000	Y
5.82 % (5.4705 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.10.2017	23.11.2018	36 816 477	%	97.310	100.000	100.000		0.000	Y
3.92 % (3.6846 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.10.2017	23.11.2018	36 816 476	%	98.300	100.000	100.000		0.000	Y
5.96 % (5.6021 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.10.2017	23.11.2018	36 816 474	%	81.780	100.000	100.000		0.000	Y
8.16 % (7.6901 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.11.2017	23.11.2018	36 816 490	%	99.480	100.000	100.000		0.000	Y
9.56 % (9.0094 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.11.2017	23.11.2018	36 816 484	%	96.480	100.000	100.000		0.000	Y
5.52 % (5.2021 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.11.2017	23.11.2018	36 816 499	%	97.420	100.000	100.000		0.000	Y
6.57 % (6.1916 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.11.2017	23.11.2018	36 816 483	%	98.220	100.000	100.000		0.000	Y
5.41 % (5.0984 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.11.2017	23.11.2018	36 816 488	%	93.830	100.000	100.000		0.000	Y
6.53 % (6.1701 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.11.2017	23.11.2018	36 816 500	%	92.960	100.000	100.000		0.000	Y
5.4 % (5.1024 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.11.2017	23.11.2018	36 816 501	%	95.290	100.000	100.000		0.000	Y
3.28 % (3.1074 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.11.2017	23.11.2018	36 816 510	%	98.330	100.000	100.000		0.000	Y
7.91 % (7.4937 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	03.11.2017	23.11.2018	36 816 515	%	97.890	100.000	100.000		0.000	Y
5.59 % (5.2958 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.11.2017	23.11.2018	36 816 514	%	99.890	100.000	100.000		0.000	Y
4.76 % (4.5095 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.11.2017	23.11.2018	36 816 507	%	98.130	100.000	100.000		0.000	Y
11.66 % (11.1342 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.11.2017	23.11.2018	36 816 525	%	88.370	100.000	100.000		0.000	Y
4.27 % (4.0775 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	06.11.2017	23.11.2018	36 816 527	%	98.760	100.000	100.000		0.000	Y
7.86 % (7.5456 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.11.2017	23.11.2018	36 816 558	%	94.050	100.000	100.000		0.000	Y
6 % (5.76 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.11.2017	23.11.2018	36 816 554	%	95.320	100.000	100.000		0.000	Y
5.22 % (5.0112 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.11.2017	23.11.2018	36 816 553	%	95.890	100.000	100.000		0.000	Y
5.06 % (4.8576 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.11.2017	23.11.2018	36 816 551	%	96.260	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.53 % (5.3088 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.11.2017	23.11.2018	36 816 550	%	98.350	100.000	100.000		0.000	Y
5.33 % (5.1168 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.11.2017	23.11.2018	36 816 557	%	97.960	100.000	100.000		0.000	Y
3.65 % (3.5134 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.11.2017	23.11.2018	36 816 560	%	98.160	100.000	100.000		0.000	Y
6.81 % (6.5551 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.11.2017	23.11.2018	36 816 563	%	96.210	100.000	100.000		0.000	Y
6.62 % (6.3722 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.11.2017	23.11.2018	36 816 564	%	96.270	100.000	100.000		0.000	Y
1.81 % (1.7469 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.11.2017	23.11.2018	36 816 570	%	97.600	100.000	100.000		0.000	Y
5.28 % (5.096 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.11.2017	23.11.2018	36 816 571	%	95.280	100.000	100.000		0.000	Y
5.55 % (5.3566 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.11.2017	23.11.2018	36 816 578	%	93.720	100.000	100.000		0.000	Y
6.62 % (6.4411 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.11.2017	23.11.2018	36 816 579	%	96.820	100.000	100.000		0.000	Y
6.6 % (6.4216 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.11.2017	23.11.2018	36 816 585	%	89.560	100.000	100.000		0.000	Y
3.87 % (3.7756 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.11.2017	23.11.2018	36 816 591	%	97.410	100.000	100.000		0.000	Y
6.22 % (6.0683 % p.a.) Reverse Convertible auf Basilea Pharmaceu N	CHF	1'000.00	14.11.2017	23.11.2018	36 816 595	%	97.280	100.000	100.000		0.000	Y
5.35 % (5.2195 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.11.2017	23.11.2018	36 816 596	%	96.550	100.000	100.000		0.000	Y
8.41 % (8.2049 % p.a.) Reverse Convertible auf ams I	CHF	1'000.00	14.11.2017	23.11.2018	36 816 597	%	87.700	100.000	100.000		0.000	Y
9.14 % (8.9171 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.11.2017	23.11.2018	36 816 598	%	93.810	100.000	100.000		0.000	Y
8.43 % (8.2244 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.11.2017	23.11.2018	36 816 599	%	98.970	100.000	100.000		0.000	Y
6.41 % (6.2537 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.11.2017	23.11.2018	36 816 590	%	97.370	100.000	100.000		0.000	Y
3.72 % (3.6391 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.11.2017	23.11.2018	36 816 604	%	98.640	100.000	100.000		0.000	Y
5.41 % (5.3068 % p.a.) Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	16.11.2017	23.11.2018	36 816 617	%	102.190	100.000	100.000		0.000	Y
7.9 % (7.7493 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.11.2017	23.11.2018	36 816 624	%	96.840	100.000	100.000		0.000	Y
7.68 % (7.5335 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.11.2017	23.11.2018	36 816 622	%	96.380	100.000	100.000		0.000	Y
8.4 % (8.2623 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.11.2017	23.11.2018	36 816 625	%	84.920	100.000	100.000		0.000	Y
5.21 % (5.1669 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	20.11.2017	23.11.2018	36 816 631	%	99.230	100.000	100.000		0.000	Y
13.68 % (13.5669 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.11.2017	23.11.2018	36 816 630	%	97.780	100.000	100.000		0.000	Y
2.45 % (2.4365 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.11.2017	23.11.2018	36 816 641	%	98.260	100.000	100.000		0.000	Y
7.75 % (7.7072 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.11.2017	23.11.2018	36 816 643	%	96.360	100.000	100.000		0.000	Y
6.27 % (6.2354 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.11.2017	23.11.2018	36 816 638	%	99.750	100.000	100.000		0.000	Y
10.75 % (10.6906 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.11.2017	23.11.2018	36 816 637	%	99.810	100.000	100.000		0.000	Y
8.57 % (8.5463 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	22.11.2017	23.11.2018	36 816 651	%	99.440	100.000	100.000		0.000	Y
6.92 % (6.9008 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	22.11.2017	23.11.2018	36 816 645	%	99.340	100.000	100.000		0.000	Y
6.79 % (6.7712 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.11.2017	23.11.2018	36 816 648	%	88.600	100.000	100.000		0.000	Y
4.11 % (4.0986 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.11.2017	23.11.2018	36 816 649	%	99.200	100.000	100.000		0.000	Y
5.53 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.11.2017	23.11.2018	36 816 657	%	99.140	100.000	100.000		0.000	Y
8.2 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.11.2017	23.11.2018	36 816 658	%	97.320	100.000	100.000		0.000	Y
6.14 % (6.4632 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.12.2017	23.11.2018	36 816 792	%	98.900	100.000	100.000		0.000	Y
4.64 % (5.0465 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.12.2017	23.11.2018	36 816 867	%	99.320	100.000	100.000		0.000	Y
6.3 % (6.852 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	22.12.2017	23.11.2018	36 816 882	%	100.000	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
8.97 % (9.7559 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.12.2017	23.11.2018	36 816 883	%	99.540	100.000	100.000		0.000	Y
7.75 % (7.2468 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.11.2017	26.11.2018	36 816 487	%	98.910	100.000	100.000		0.000	Y
4.89 % (4.745 % p.a.) Reverse Convertible auf Netflix Rg	CHF	1'000.00	15.11.2017	26.11.2018	36 816 601	%	97.130	100.000	100.000		0.000	Y
4.84 % (4.6965 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.11.2017	26.11.2018	36 816 610	%	97.690	100.000	100.000		0.000	Y
5.51 % (5.3611 % p.a.) Reverse Convertible auf Netflix Rg	CHF	1'000.00	16.11.2017	26.11.2018	36 816 620	%	98.370	100.000	100.000		0.000	Y
3.36 % (3.2692 % p.a.) Reverse Convertible auf Netflix Rg	CHF	1'000.00	16.11.2017	26.11.2018	36 816 619	%	97.570	100.000	100.000		0.000	Y
11.01 % Reverse Convertible auf Meyer Burger N	CHF	1'000.00	30.11.2017	30.11.2018	36 816 707	%	92.600	100.000	100.000		0.000	Y
5.87 % (3.9061 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	02.06.2017	03.12.2018	34 415 450	%	101.640	100.000	100.000		0.000	Y
9.66 % (9.1757 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.11.2017	06.12.2018	36 816 627	%	98.160	100.000	100.000		0.000	Y
5.07 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.12.2017	06.12.2018	36 816 749	%	98.410	100.000	100.000		0.000	Y
5.19 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.12.2017	06.12.2018	36 816 748	%	97.980	100.000	100.000		0.000	Y
9.84 % (8.5565 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.10.2017	07.12.2018	36 816 393	%	95.180	100.000	100.000		0.000	Y
9.85 % (9.3316 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.11.2017	07.12.2018	36 816 629	%	95.130	100.000	100.000		0.000	Y
8.87 % (8.8454 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.12.2017	07.12.2018	36 816 745	%	96.820	100.000	100.000		0.000	Y
8.64 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.12.2017	07.12.2018	36 816 763	%	97.580	100.000	100.000		0.000	Y
6.91 % (6.8529 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.12.2017	10.12.2018	36 816 758	%	98.780	100.000	100.000		0.000	Y
8.85 % (8.8011 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.12.2017	10.12.2018	36 816 778	%	99.970	100.000	100.000		0.000	Y
4.69 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.12.2017	14.12.2018	36 816 821	%	97.810	100.000	100.000		0.000	Y
9.54 % (7.1401 % p.a.) Reverse Convertible auf ams I	CHF	1'000.00	16.08.2017	17.12.2018	36 816 016	%	98.430	100.000	100.000		0.000	Y
5.16 % (5.1315 % p.a.) Reverse Convertible auf Vifor Pharma N	CHF	1'000.00	15.12.2017	17.12.2018	36 816 839	%	100.180	100.000	100.000		0.000	Y
5.59 % (5.5591 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.12.2017	17.12.2018	36 816 838	%	98.800	100.000	100.000		0.000	Y
7.4 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.12.2017	18.12.2018	36 816 849	%	98.960	100.000	100.000		0.000	Y
6.66 % (6.533 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.12.2017	21.12.2018	36 816 823	%	99.980	100.000	100.000		0.000	Y
8.54 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.12.2017	21.12.2018	36 816 874	%	100.250	100.000	100.000		0.000	Y
5.91 % (5.8773 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.12.2017	24.12.2018	36 816 889	%	97.870	100.000	100.000		0.000	Y
6.19 % (4.3103 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.07.2017	27.12.2018	36 815 901	%	101.540	100.000	100.000		0.000	Y
8.86 % (7.9146 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	17.11.2017	31.12.2018	36 816 628	%	98.150	100.000	100.000		0.000	Y
6.77 % (4.3756 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.06.2017	03.01.2019	34 415 535	%	99.250	100.000	100.000		0.000	Y
6.64 % (4.3226 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	20.06.2017	03.01.2019	34 415 549	%	101.130	100.000	100.000		0.000	Y
6.93 % (5.8979 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.10.2017	03.01.2019	36 816 473	%	91.670	100.000	100.000		0.000	Y
7.58 % (6.4664 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.11.2017	03.01.2019	36 816 489	%	99.160	100.000	100.000		0.000	Y
6.32 % (5.5628 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.11.2017	03.01.2019	36 816 594	%	96.220	100.000	100.000		0.000	Y
3.88 % (3.5008 % p.a.) Reverse Convertible auf GAM Hldg N	CHF	1'000.00	24.11.2017	03.01.2019	36 816 670	%	98.140	100.000	100.000		0.000	Y
3.55 % (3.203 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.11.2017	03.01.2019	36 816 671	%	97.630	100.000	100.000		0.000	Y
5.32 % (4.8 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.11.2017	03.01.2019	36 816 673	%	98.250	100.000	100.000		0.000	Y
4.75 % (4.2857 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.11.2017	03.01.2019	36 816 669	%	97.580	100.000	100.000		0.000	Y
4.65 % (4.1955 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.11.2017	03.01.2019	36 816 667	%	99.470	100.000	100.000		0.000	Y
3.56 % (3.212 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	24.11.2017	03.01.2019	36 816 666	%	98.020	100.000	100.000		0.000	Y
5.35 % (4.8636 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.11.2017	03.01.2019	36 816 676	%	99.400	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
3.76 % (3.4182 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	27.11.2017	03.01.2019	36 816 674	%	98.710	100.000	100.000		0.000	Y
3.44 % (3.1273 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.11.2017	03.01.2019	36 816 679	%	97.640	100.000	100.000		0.000	Y
4.64 % (4.2182 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.11.2017	03.01.2019	36 816 680	%	98.410	100.000	100.000		0.000	Y
8.67 % (7.8818 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.11.2017	03.01.2019	36 816 675	%	99.240	100.000	100.000		0.000	Y
5.58 % (5.0856 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.11.2017	03.01.2019	36 816 689	%	97.570	100.000	100.000		0.000	Y
5.16 % (4.7028 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.11.2017	03.01.2019	36 816 683	%	98.350	100.000	100.000		0.000	Y
6.87 % (6.2613 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.11.2017	03.01.2019	36 816 685	%	98.700	100.000	100.000		0.000	Y
5.19 % (4.7301 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.11.2017	03.01.2019	36 816 691	%	97.910	100.000	100.000		0.000	Y
6.86 % (6.268 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.11.2017	03.01.2019	36 816 698	%	96.280	100.000	100.000		0.000	Y
3.02 % (2.7594 % p.a.) Reverse Convertible auf Swisscom N	CHF	1'000.00	29.11.2017	03.01.2019	36 816 694	%	99.190	100.000	100.000		0.000	Y
6.28 % (5.7381 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	29.11.2017	03.01.2019	36 816 696	%	96.460	100.000	100.000		0.000	Y
5.33 % (4.8824 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.11.2017	03.01.2019	36 816 709	%	99.160	100.000	100.000		0.000	Y
8.16 % (7.4748 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.11.2017	03.01.2019	36 816 711	%	98.610	100.000	100.000		0.000	Y
11.4 % (10.4427 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.11.2017	03.01.2019	36 816 712	%	82.160	100.000	100.000		0.000	Y
8.74 % (8.0061 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.11.2017	03.01.2019	36 816 703	%	99.080	100.000	100.000		0.000	Y
7.01 % (6.4378 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.12.2017	03.01.2019	36 816 716	%	97.290	100.000	100.000		0.000	Y
6.04 % (5.5469 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.12.2017	03.01.2019	36 816 719	%	98.590	100.000	100.000		0.000	Y
7.01 % (6.4378 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.12.2017	03.01.2019	36 816 714	%	99.360	100.000	100.000		0.000	Y
4.36 % (4.0041 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	01.12.2017	03.01.2019	36 816 715	%	99.590	100.000	100.000		0.000	Y
6.54 % (6.0061 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.12.2017	03.01.2019	36 816 713	%	98.930	100.000	100.000		0.000	Y
4.66 % (4.3126 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.12.2017	03.01.2019	36 816 721	%	98.620	100.000	100.000		0.000	Y
5.39 % (4.9882 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.12.2017	03.01.2019	36 816 722	%	98.450	100.000	100.000		0.000	Y
8.64 % (7.9959 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.12.2017	03.01.2019	36 816 723	%	97.160	100.000	100.000		0.000	Y
4.82 % (4.4722 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	05.12.2017	03.01.2019	36 816 738	%	99.040	100.000	100.000		0.000	Y
4.68 % (4.3423 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.12.2017	03.01.2019	36 816 737	%	98.180	100.000	100.000		0.000	Y
2.95 % (2.7371 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.12.2017	03.01.2019	36 816 736	%	99.130	100.000	100.000		0.000	Y
4.69 % (4.3515 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.12.2017	03.01.2019	36 816 739	%	98.050	100.000	100.000		0.000	Y
8.19 % (7.599 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.12.2017	03.01.2019	36 816 735	%	98.720	100.000	100.000		0.000	Y
4.99 % (4.6299 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.12.2017	03.01.2019	36 816 731	%	99.190	100.000	100.000		0.000	Y
6.5 % (6.0309 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	05.12.2017	03.01.2019	36 816 732	%	99.460	100.000	100.000		0.000	Y
6.73 % (6.2443 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	05.12.2017	03.01.2019	36 816 734	%	99.510	100.000	100.000		0.000	Y
7.09 % (6.5784 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.12.2017	03.01.2019	36 816 730	%	98.980	100.000	100.000		0.000	Y
5.07 % (4.7163 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	10'000.00	06.12.2017	03.01.2019	36 816 744	%	98.830	100.000	100.000		0.000	Y
5 % (4.6512 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.12.2017	03.01.2019	36 816 743	%	94.380	100.000	100.000		0.000	Y
4.63 % (4.307 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.12.2017	03.01.2019	36 816 740	%	98.500	100.000	100.000		0.000	Y
3.74 % (3.4791 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.12.2017	03.01.2019	36 816 741	%	98.070	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
8.01 % (7.4705 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.12.2017	03.01.2019	36 816 759	%	90.300	100.000	100.000		0.000	Y
5.59 % (5.2135 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.12.2017	03.01.2019	36 816 757	%	100.230	100.000	100.000		0.000	Y
6.99 % (6.5192 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	07.12.2017	03.01.2019	36 816 756	%	99.480	100.000	100.000		0.000	Y
6.68 % (6.2301 % p.a.) Reverse Convertible auf LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	07.12.2017	03.01.2019	36 816 753	%	99.980	100.000	100.000		0.000	Y
10.15 % (9.4663 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.12.2017	03.01.2019	36 816 761	%	98.060	100.000	100.000		0.000	Y
5.05 % (4.7221 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.12.2017	03.01.2019	36 816 786	%	98.620	100.000	100.000		0.000	Y
5.8 % (5.4234 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.12.2017	03.01.2019	36 816 779	%	97.940	100.000	100.000		0.000	Y
5.8 % (5.4234 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.12.2017	03.01.2019	36 816 780	%	97.920	100.000	100.000		0.000	Y
5.58 % (5.2177 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.12.2017	03.01.2019	36 816 781	%	97.740	100.000	100.000		0.000	Y
6.61 % (6.1808 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	08.12.2017	03.01.2019	36 816 782	%	98.340	100.000	100.000		0.000	Y
7.24 % (6.7699 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.12.2017	03.01.2019	36 816 784	%	98.920	100.000	100.000		0.000	Y
5.93 % (5.5885 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.12.2017	03.01.2019	36 816 787	%	98.600	100.000	100.000		0.000	Y
1.97 % (1.8565 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.12.2017	03.01.2019	36 816 788	%	98.240	100.000	100.000		0.000	Y
6.27 % (5.9089 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.12.2017	03.01.2019	36 816 789	%	99.640	100.000	100.000		0.000	Y
4.92 % (4.6366 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.12.2017	03.01.2019	36 816 791	%	99.150	100.000	100.000		0.000	Y
3.15 % (2.9686 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.12.2017	03.01.2019	36 816 793	%	98.410	100.000	100.000		0.000	Y
9.39 % (8.8492 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.12.2017	03.01.2019	36 816 794	%	98.900	100.000	100.000		0.000	Y
6.32 % (5.956 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.12.2017	03.01.2019	36 816 796	%	99.310	100.000	100.000		0.000	Y
4.43 % (4.1749 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	11.12.2017	03.01.2019	36 816 795	%	97.880	100.000	100.000		0.000	Y
6 % (5.6693 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.12.2017	03.01.2019	36 816 803	%	99.530	100.000	100.000		0.000	Y
5.36 % (5.0646 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.12.2017	03.01.2019	36 816 801	%	99.150	100.000	100.000		0.000	Y
5.5 % (5.1969 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.12.2017	03.01.2019	36 816 802	%	98.570	100.000	100.000		0.000	Y
5.05 % (4.7842 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.12.2017	03.01.2019	36 816 808	%	99.750	100.000	100.000		0.000	Y
7.39 % (7.0011 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.12.2017	03.01.2019	36 816 809	%	99.130	100.000	100.000		0.000	Y
5.21 % (4.9358 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.12.2017	03.01.2019	36 816 814	%	98.990	100.000	100.000		0.000	Y
5.94 % (5.6274 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.12.2017	03.01.2019	36 816 810	%	100.290	100.000	100.000		0.000	Y
4.27 % (4.0559 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.12.2017	03.01.2019	36 816 815	%	97.230	100.000	100.000		0.000	Y
7.06 % (6.7061 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.12.2017	03.01.2019	36 816 816	%	98.470	100.000	100.000		0.000	Y
7.04 % (6.6871 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.12.2017	03.01.2019	36 816 818	%	99.280	100.000	100.000		0.000	Y
5.47 % (5.1958 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	14.12.2017	03.01.2019	36 816 822	%	99.740	100.000	100.000		0.000	Y
6.08 % (5.7752 % p.a.) Reverse Convertible auf Novartis N	CHF	1'000.00	14.12.2017	03.01.2019	36 816 826	%	99.110	100.000	100.000		0.000	Y
5.21 % (4.9488 % p.a.) Reverse Convertible auf Nestle N	CHF	1'000.00	14.12.2017	03.01.2019	36 816 827	%	97.480	100.000	100.000		0.000	Y
4.57 % (4.3524 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.12.2017	03.01.2019	36 816 844	%	98.680	100.000	100.000		0.000	Y
5.29 % (5.0381 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	15.12.2017	03.01.2019	36 816 834	%	98.210	100.000	100.000		0.000	Y
5.08 % (4.8381 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.12.2017	03.01.2019	36 816 840	%	100.010	100.000	100.000		0.000	Y
5.97 % (5.6857 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.12.2017	03.01.2019	36 816 837	%	96.860	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
3.16 % (3.0095 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.12.2017	03.01.2019	36 816 841	%	98.540	100.000	100.000		0.000	Y
5.99 % (5.7504 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.12.2017	03.01.2019	36 816 846	%	99.030	100.000	100.000		0.000	Y
4.85 % (4.656 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	18.12.2017	03.01.2019	36 816 847	%	98.430	100.000	100.000		0.000	Y
8.57 % (8.2492 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.12.2017	03.01.2019	36 816 855	%	98.510	100.000	100.000		0.000	Y
6.71 % (6.4588 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	19.12.2017	03.01.2019	36 816 850	%	99.730	100.000	100.000		0.000	Y
8.11 % (7.8064 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.12.2017	03.01.2019	36 816 854	%	98.440	100.000	100.000		0.000	Y
13.68 % (13.2032 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.12.2017	03.01.2019	36 816 863	%	96.890	100.000	100.000		0.000	Y
5.2 % (5.0188 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.12.2017	03.01.2019	36 816 869	%	98.590	100.000	100.000		0.000	Y
5.36 % (5.1732 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.12.2017	03.01.2019	36 816 864	%	98.350	100.000	100.000		0.000	Y
4.78 % (4.6258 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.12.2017	03.01.2019	36 816 876	%	98.430	100.000	100.000		0.000	Y
7.48 % (7.2387 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.12.2017	03.01.2019	36 816 877	%	99.970	100.000	100.000		0.000	Y
4.74 % (4.5995 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.12.2017	03.01.2019	36 816 881	%	98.510	100.000	100.000		0.000	Y
10.38 % (10.0722 % p.a.) Reverse Convertible auf ams I	CHF	1'000.00	22.12.2017	03.01.2019	36 816 886	%	97.640	100.000	100.000		0.000	Y
7.09 % (6.8798 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.12.2017	03.01.2019	36 816 884	%	100.150	100.000	100.000		0.000	Y
6.5 % (6.3934 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.12.2017	03.01.2019	36 816 890	%	98.430	100.000	100.000		0.000	Y
5.43 % (5.341 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.12.2017	03.01.2019	36 816 900	%	97.450	100.000	100.000		0.000	Y
4.89 % (4.8098 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	27.12.2017	03.01.2019	36 816 899	%	99.130	100.000	100.000		0.000	Y
7.21 % (7.0918 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.12.2017	03.01.2019	36 816 897	%	98.950	100.000	100.000		0.000	Y
3.79 % (3.7279 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.12.2017	03.01.2019	36 816 893	%	98.050	100.000	100.000		0.000	Y
6.54 % (6.4504 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.12.2017	03.01.2019	36 816 905	%	98.020	100.000	100.000		0.000	Y
6.33 % (6.2433 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	28.12.2017	03.01.2019	36 816 904	%	96.950	100.000	100.000		0.000	Y
6.74 % (6.3518 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.12.2017	07.01.2019	36 816 833	%	99.900	100.000	100.000		0.000	Y
10.52 % (6.8485 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.07.2017	25.01.2019	36 815 869	%	102.070	100.000	100.000		0.000	Y
8.28 % (6.4103 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.10.2017	25.01.2019	36 816 355	%	96.260	100.000	100.000		0.000	Y
10.97 % (8.9959 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.11.2017	25.01.2019	36 816 521	%	87.720	100.000	100.000		0.000	Y
6.48 % (5.3382 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.11.2017	25.01.2019	36 816 549	%	97.610	100.000	100.000		0.000	Y
7.3 % (6.0414 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	10'000.00	10.11.2017	25.01.2019	36 816 575	%	94.660	100.000	100.000		0.000	Y
12.72 % (11.1416 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.12.2017	25.01.2019	36 816 725	%	98.440	100.000	100.000		0.000	Y
6.75 % (6.1364 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.12.2017	25.01.2019	36 816 851	%	99.450	100.000	100.000		0.000	Y
7.63 % (7.0794 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.12.2017	25.01.2019	36 816 896	%	97.920	100.000	100.000		0.000	Y
11.48 % (10.6515 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.12.2017	25.01.2019	36 816 895	%	98.170	100.000	100.000		0.000	Y
3.74 % (3.1981 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.11.2017	01.02.2019	36 816 702	%	99.350	100.000	100.000		0.000	Y
5.3 % (4.5429 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.12.2017	06.02.2019	36 816 751	%	99.850	100.000	100.000		0.000	Y
11.31 % (9.7174 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.12.2017	06.02.2019	36 816 764	%	95.740	100.000	100.000		0.000	Y
10.27 % (8.8239 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	07.12.2017	06.02.2019	36 816 760	%	96.970	100.000	100.000		0.000	Y
6.51 % (5.2196 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.11.2017	08.02.2019	36 816 566	%	95.310	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.58 % (4.5345 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.11.2017	08.02.2019	36 816 602	%	95.900	100.000	100.000		0.000	Y
6.08 % (4.56 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	19.10.2017	19.02.2019	36 816 415	%	98.860	100.000	100.000		0.000	Y
4.79 % (2.324 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.01.2017	22.02.2019	34 414 467	%	102.470	100.000	100.000		0.000	Y
5.38 % (2.6351 % p.a.) Reverse Convertible auf Roche Hldg G	CHF	1'000.00	07.02.2017	22.02.2019	34 414 550	%	103.620	100.000	100.000		0.000	Y
4.09 % (2.6387 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.08.2017	22.02.2019	36 815 955	%	97.140	100.000	100.000		0.000	Y
7.82 % (5.9267 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.10.2017	22.02.2019	36 816 456	%	92.260	100.000	100.000		0.000	Y
8.36 % (6.3763 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.10.2017	22.02.2019	36 816 468	%	98.380	100.000	100.000		0.000	Y
5.24 % (3.9966 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.10.2017	22.02.2019	36 816 464	%	94.550	100.000	100.000		0.000	Y
5.39 % (4.111 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	30.10.2017	22.02.2019	36 816 467	%	94.770	100.000	100.000		0.000	Y
5.53 % (4.3373 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.11.2017	22.02.2019	36 816 582	%	93.870	100.000	100.000		0.000	Y
6.84 % (5.3647 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	13.11.2017	22.02.2019	36 816 583	%	92.530	100.000	100.000		0.000	Y
10.02 % (7.9982 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.11.2017	22.02.2019	36 816 639	%	96.510	100.000	100.000		0.000	Y
2.06 % (1.648 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.11.2017	22.02.2019	36 816 655	%	97.990	100.000	100.000		0.000	Y
7.67 % (6.3185 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.12.2017	22.02.2019	36 816 727	%	98.240	100.000	100.000		0.000	Y
7.88 % (6.4915 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	05.12.2017	22.02.2019	36 816 728	%	99.870	100.000	100.000		0.000	Y
7 % (4.8743 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.09.2017	27.02.2019	36 816 211	%	97.670	100.000	100.000		0.000	Y
6.09 % (4.2406 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.09.2017	27.02.2019	36 816 210	%	96.400	100.000	100.000		0.000	Y
6.46 % (4.4983 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.09.2017	27.02.2019	36 816 212	%	99.660	100.000	100.000		0.000	Y
10.42 % (8.1548 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.11.2017	07.03.2019	36 816 681	%	97.380	100.000	100.000		0.000	Y
4.43 % (3.5361 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.12.2017	07.03.2019	36 816 752	%	98.040	100.000	100.000		0.000	Y
7.89 % (5.0095 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	25.08.2017	22.03.2019	36 816 063	%	101.520	100.000	100.000		0.000	Y
7.69 % (4.926 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	20'000.00	30.08.2017	22.03.2019	36 816 091	%	92.570	100.000	100.000		0.000	Y
8.37 % (5.3616 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	30.08.2017	22.03.2019	36 816 094	%	95.190	100.000	100.000		0.000	Y
10.16 % (6.5784 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.09.2017	22.03.2019	36 816 138	%	100.540	100.000	100.000		0.000	Y
7.16 % (4.6951 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	13.09.2017	22.03.2019	36 816 174	%	97.630	100.000	100.000		0.000	Y
11.35 % (7.4698 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.09.2017	22.03.2019	36 816 190	%	94.960	100.000	100.000		0.000	Y
15.16 % (10.1821 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.09.2017	22.03.2019	36 816 257	%	98.800	100.000	100.000		0.000	Y
6.15 % (4.6709 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.11.2017	22.03.2019	36 816 688	%	98.140	100.000	100.000		0.000	Y
8.87 % (6.7796 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.12.2017	22.03.2019	36 816 718	%	99.200	100.000	100.000		0.000	Y
8.27 % (5.5133 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	26.09.2017	26.03.2019	36 816 264	%	96.480	100.000	100.000		0.000	Y
6.55 % (3.1694 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	06.04.2017	30.04.2019	34 415 076	%	100.310	100.000	100.000		0.000	Y
4.59 % (2.2667 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.04.2017	30.04.2019	34 415 142	%	99.000	100.000	100.000		0.000	Y
6.29 % (4.0007 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	04.10.2017	30.04.2019	36 816 316	%	96.410	100.000	100.000		0.000	Y
9.56 % (6.0913 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	05.10.2017	30.04.2019	36 816 338	%	99.410	100.000	100.000		0.000	Y
5.67 % (3.6581 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.10.2017	30.04.2019	36 816 376	%	94.080	100.000	100.000		0.000	Y
6.96 % (4.8938 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	28.11.2017	30.04.2019	36 816 690	%	97.560	100.000	100.000		0.000	Y

Derivative Finanzinstrumente (Schweiz) / Produits financiers dérivés (Suisse) / Strumenti finanziari derivati (Svizzera)

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
7.64 % (5.0933 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	16.11.2017	16.05.2019	36 816 616	%	95.330	100.000	100.000		0.000	Y
8.72 % (4.2024 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.04.2017	24.05.2019	34 415 200	%	100.010	100.000	100.000		0.000	Y
10.33 % (5.0186 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.05.2017	24.05.2019	34 415 236	%	98.470	100.000	100.000		0.000	Y
11.87 % (5.806 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.05.2017	24.05.2019	34 415 275	%	101.230	100.000	100.000		0.000	Y
9.73 % (4.7657 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	09.05.2017	24.05.2019	34 415 292	%	97.070	100.000	100.000	24.11.	0.000	N
7.49 % (3.6988 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.05.2017	24.05.2019	34 415 331	%	100.460	100.000	100.000		0.000	Y
6.53 % (3.2605 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.05.2017	24.05.2019	34 415 377	%	91.590	100.000	100.000		0.000	Y
7.24 % (4.6295 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.11.2017	24.05.2019	36 816 496	%	91.850	100.000	100.000		0.000	Y
5.04 % (3.2285 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	02.11.2017	24.05.2019	36 816 502	%	96.560	100.000	100.000		0.000	Y
6.87 % (4.5631 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	22.11.2017	24.05.2019	36 816 654	%	99.140	100.000	100.000		0.000	Y
7.48 % (4.9774 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.11.2017	24.05.2019	36 816 659	%	97.020	100.000	100.000		0.000	Y
7.21 % (3.4701 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.05.2017	28.06.2019	34 415 433	%	95.470	100.000	100.000		0.000	Y
11.89 % (5.7225 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	31.05.2017	28.06.2019	34 415 434	%	95.870	100.000	100.000		0.000	Y
7.46 % (4.7033 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	27.11.2017	28.06.2019	36 816 677	%	95.440	100.000	100.000		0.000	Y
9.26 % (6.0282 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	15.12.2017	28.06.2019	36 816 842	%	98.380	100.000	100.000		0.000	Y
10.55 % (5.7545 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.09.2017	12.07.2019	36 816 164	%	96.510	100.000	100.000		0.000	Y
7.35 % (3.675 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.11.2017	01.11.2019	36 816 493	%	97.550	100.000	100.000		0.000	Y
7.35 % (3.675 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	01.11.2017	01.11.2019	36 816 491	%	97.550	100.000	100.000		0.000	Y
16.86 % (5.6252 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	23.11.2016	22.11.2019	32 772 079	%	105.260	100.000	100.000		0.000	Y
10.67 % (5.2475 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	10.11.2017	22.11.2019	36 816 569	%	93.410	100.000	100.000		0.000	Y
10.77 % (5.3405 % p.a.) Reverse Convertible auf Alibaba Grp Sp ADS	CHF	1'000.00	16.11.2017	22.11.2019	36 816 623	%	95.340	100.000	100.000		0.000	Y
14.05 % (7.0153 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	21.11.2017	22.11.2019	36 816 634	%	97.050	100.000	100.000		0.000	Y
13.2 % (6.5908 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.12.2017	09.12.2019	36 816 769	%	93.680	100.000	100.000		0.000	Y
15.06 % (7.53 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.12.2017	20.12.2019	36 816 870	%	97.040	100.000	100.000		0.000	Y
8.07 % (3.9154 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	08.12.2017	31.12.2019	36 816 768	%	98.550	100.000	100.000		0.000	Y
13.52 % (6.5951 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	12.12.2017	31.12.2019	36 816 806	%	97.430	100.000	100.000		0.000	Y
9.51 % (3.3336 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.03.2017	10.01.2020	34 414 814	%	99.210	100.000	100.000		0.000	Y
9.5 % (3.3301 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	03.03.2017	10.01.2020	34 414 816	%	99.190	100.000	100.000		0.000	Y
14.82 % (4.9263 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien	CHF	1'000.00	20.10.2017	23.10.2020	36 816 421	%	90.600	100.000	100.000		0.000	Y

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
3D Systems Corporation, Rock Hill, USA											
Namenaktien	USD	0.001	366 612	8.410				USD	0.000		0.000
3M Company, St. Paul, USA											
	USD	0.010	1 405 105	229.360	15.02.	12.03.		USD	1.175		1.183
					17.05.	12.06.		USD	1.175		1.138
					23.08.	12.09.		USD	1.175		1.127
					22.11.	12.12.		USD	1.175		1.166

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Aareal Bank AG, Wiesbaden, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	1 415 078	43.690	01.06.	05.06.		EUR	2.000		2.170	
Abbott Laboratories, Abbott Park, USA												
Stammaktien	USD	0.000	903 037	56.060	11.01.	15.02.		USD	0.265		0.26723	
					11.04.	15.05.		USD	0.265		0.2641	
					12.07.	15.08.		USD	0.265		0.2578	
					12.10.	15.11.		USD	0.265		0.26227	
AbbVie Inc., North Chicago, USA												
Namenaktien	USD	0.010	20 145 667	94.240	11.01.	15.02.		USD	0.640		0.64538	
					11.04.	15.05.		USD	0.640		0.63784	
					12.07.	15.08.	FR0013272663	USD	0.640		0.62263	
					12.10.	15.11.		USD	0.640		0.63341	
21.12.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben												
Abercrombie & Fitch Co., New Albany, USA												
Namenaktien	USD	0.010	522 413	16.980	01.03.	13.03.		USD	0.200		0.20136	
					31.05.	12.06.		USD	0.200		0.19383	
					30.08.	11.09.		USD	0.200		0.1904	
					30.11.	11.12.		USD	0.200		0.19811	
Accor S.A., Paris, Frankreich												
au porteur	EUR	3.00	485 822	50.020								
12.5.2017 au choix en espèces ou en actions					12.05.	06.06.		EUR	1.050		1.139	(Q)
Activision Blizzard, Inc., Santa Monica, USA												
Namenaktien	USD	0.000001	3 971 431	61.820	28.03.	10.05.		USD	0.300		0.30252	
Adidas AG, Herzogenaurach, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	11 730 015	195.820	12.05.	16.05.		EUR	2.000		2.188	
ADO Properties S.A., Luxemburg												
Namenaktien	EUR	0.000	28 642 381	49.470		05.05.		EUR	0.450		0.48858	
Adobe Systems Incorporated, San Jose, USA												
Namenaktien	USD	0.0001	903 472	170.760				USD	0.000		0.000	
ADVA Optical Networking SE, München, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	498 244	7.040				EUR	0.000		0.000	
Advanced Micro Devices, Inc., Sunnyvale, USA												
Namenaktien	USD	0.010	903 491	10.250				USD	0.000		0.000	
AEGON N.V., Den Haag, Niederlande												
Namenaktien	EUR	0.120	2 545 785	6.220								
23.5.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					23.05.	23.06.		EUR	0.130		0.14105	(V)
18.8.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					18.08.	15.09.		EUR	0.130		0.14935	(V)
ageas NV, Bruxelles, Belgien												
nominatives	EUR	0.000	18 954 172	47.640	29.05.	31.05.		EUR	2.100		2.284	
Agfa-Gevaert N.V., Mortsel, Belgien												
Inhaberaktien	EUR	0.000	748 779	4.530				EUR	0.000		0.000	
Agnico Eagle Mines Limited, Toronto, Kanada												
Namenaktien	CAD	0.000	676 894	45.140	27.02.	15.03.		USD	0.100		0.1008	
					30.05.	15.06.		USD	0.100		0.09748	
					30.08.	15.09.		USD	0.100		0.09602	
					30.11.	15.12.		USD	0.110		0.1091	
AIR France-KLM, Paris, Frankreich												
au porteur	EUR	1.00	62 461	15.890				EUR	0.000		0.000	

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Air (L') Liquide S.A., Paris, Frankreich												
Inhaberaktien	EUR	5.50	502 455	123.940	15.05.	17.05.		EUR	2.600		2.837	
2.10.2017 B.V.: 10 act. anc. = 1 nouv. (gratuite)					02.10.	04.10.		EUR	0.550		0.62834	
Airbus SE, Leiden, Niederlande												
Inhaberaktien	EUR	1.00	1 095 306	97.590	18.04.	20.04.		EUR	1.350		1.446	
AIXTRON SE, Herzogenrath, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	4 566 068	13.550				EUR	0.000		0.000	
Akzo Nobel N.V., Amsterdam, Niederlande												
Stammaktien	EUR	2.00	857 349	85.460								
27.4.2017 wahlweise in bar oder Aktien					27.04.	24.05.		EUR	1.280		1.398	(V)
20.10.2017 wahlweise in bar oder Aktien					20.10.	22.11.		EUR	0.560		0.64904	(V)
					04.12.	07.12.		EUR	4.000		4.683	(B)
Alexion Pharmaceuticals, Inc., Cheshire, USA												
Namenaktien	USD	0.0001	440 290	118.180				USD	0.000		0.000	
24.11.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben												
Alibaba Group Holding Limited, George Town, Kaimaninseln												
Namenaktien	USD	0.000025	24 409 862	171.000				USD	0.000		0.000	
Allianz SE, München, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	322 646	224.870	04.05.	08.05.		EUR	7.600		8.286	
Alphabet Inc., Mountain View, USA												
Namenaktien	USD	0.001	29 798 540	999.000				USD	0.000		0.000	
Alstom, Paris, Frankreich												
Inhaberaktien	EUR	7.00	2 229 080	40.470	07.07.	11.07.		EUR	0.250		0.27646	
alstria office REIT-Aktiengesellschaft, Hamburg, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	1.00	3 014 033	15.040								
17.5.2017 Ohne Deutsche Kapitalertragsteuer, daher keinen Anspruch auf pauschale Steueranrechnung					17.05.	19.05.		EUR	0.520		0.56729	(Z)
Altaba Inc., Sunnyvale, USA												
Namenaktien	USD	0.001	453 745	-				USD	0.000		0.000	
19.6.2017 Reorganisation/ Titelumtausch: 1 Akt. Altaba Inc. (vormals Yahoo! Inc.) von USD 0.001 nom. = 1 Akt. Altaba Inc. (neu) von USD 0.001 nom. (VN 36819159)						19.06.		USD	0.000		0.000	
Altaba Inc., New York, USA												
Namenaktien	USD	0.001	36 819 159	68.100				USD	0.000		0.000	
Altria Group, Inc., Richmond, USA												
Stammaktien	USD	0.333	1 331 740	69.830	20.12.	10.01.		USD	0.610		0.61835	
					13.03.	10.04.		USD	0.610		0.61492	
					13.06.	10.07.		USD	0.610		0.58975	
					14.09.	10.10.		USD	0.660		0.64299	
AMADEUS FIRE AG, Frankfurt/ Main, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	985 601	90.310	19.05.	23.05.		EUR	3.660		3.993	
Amazon.Com, Inc., Seattle, USA												
Namenaktien	USD	0.010	645 156	1160.060				USD	0.000		0.000	

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
American Airlines Group Inc., Fort Worth, USA											
Namenaktien	USD	0.010	22 053 992	51.000	09.02.	27.02.		USD	0.100		0.10056
					12.05.	30.05.		USD	0.100		0.09753
					10.08.	28.08.		USD	0.100		0.0955
					10.11.	27.11.		USD	0.100		0.09809
American Express Company, New York, USA											
Stammaktien	USD	0.200	906 153	98.260	04.01.	10.02.		USD	0.320		0.32156
					05.04.	10.05.		USD	0.320		0.32269
					05.07.	10.08.		USD	0.320		0.30845
					05.10.	10.11.		USD	0.350		0.34815
American International Group, Inc., New York, USA											
Namenaktien	USD	2.50	10 315 741	58.050	13.03.	29.03.		USD	0.320		0.31906
					12.06.	28.06.		USD	0.320		0.30725
					14.09.	29.09.		USD	0.320		0.30961
					07.12.	22.12.		USD	0.320		0.31674
Amgen Inc., Thousand Oaks, USA											
Stammaktien	USD	0.0001	907 582	171.620	13.02.	08.03.		USD	1.150		1.166
					15.05.	08.06.		USD	1.150		1.112
					15.08.	08.09.		USD	1.150		1.089
					16.11.	08.12.		USD	1.150		1.143
ams AG, Unterpremstätten, Österreich											
Inhaberaktien	EUR	0.000	24 924 656	88.450	13.06.	16.06.		EUR	0.300		0.32689
Andritz AG, Graz, Österreich											
Inhaberaktien	EUR	0.000	1 130 459	55.090	30.03.	03.04.		EUR	1.500		1.602
24.11.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben											
Anglo American Plc, London, Grossbritannien											
Namenaktien	USD	0.549	3 186 826	19.000	10.08.	22.09.		GBP	0.36939		0.48416
AngloGold Ashanti Limited, Johannesburg, Südafrika											
Namenaktien	ZAR	0.250	920 993	9.920	22.03.	17.04.		USD	0.09443		0.09459
ADR											
Anheuser-Busch InBev SA/NV, Bruxelles, Belgien											
Namenaktien	EUR	0.000	34 149 140	108.700	02.05.	04.05.		EUR	2.000		2.169
					14.11.	16.11.		EUR	1.600		1.870
Apple Inc., Cupertino, USA											
Stammaktien	USD	0.00001	908 440	167.080	09.02.	16.02.		USD	0.570		0.56922
					11.05.	18.05.		USD	0.630		0.61641
					10.08.	17.08.		USD	0.630		0.60741
					10.11.	16.11.		USD	0.630		0.62577
Applied Materials, Inc., Santa Clara, USA											
Namenaktien	USD	0.010	908 542	49.810	17.02.	15.03.		USD	0.100		0.1008
					23.05.	15.06.		USD	0.100		0.09748
					22.08.	14.09.		USD	0.100		0.09668
					22.11.	14.12.		USD	0.100		0.09901
ArcelorMittal S.A., Luxemburg											
Namenaktien	EUR	0.000	36 780 521	31.270				EUR	0.000		0.000
Namenaktien	EUR	0.000	3 529 315	-				EUR	0.000		0.000
18.5.2017 Zusammenlegung: 3 Akt. ohne Nennwert = 1 Akt. ohne Nennwert (VN 36780521)					18.05.	18.05.		EUR	0.000		0.000
Archer-Daniels-Midland Company, Decatur, USA											
Stammaktien	USD	0.000	908 597	39.200	16.02.	14.03.		USD	0.320		0.32248
					16.05.	08.06.		USD	0.320		0.30949
					15.08.	07.09.		USD	0.320		0.30486
					15.11.	07.12.		USD	0.320		0.31777

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Arconic Inc., New York, NY, USA											
Namenaktien	USD	1.00	34 298 366	26.550	01.02.	25.02.		USD	0.060		0.06033
					03.05.	25.05.		USD	0.060		0.05833
					02.08.	25.08.		USD	0.060		0.0575
					02.11.	25.11.		USD	0.060		0.05885
25.11.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben											
ARIAD Pharmaceuticals, Inc., Cambridge, USA											
Namenaktien	USD	0.001	249 585	-				USD	0.000		0.000
9.1.2017 Kaufofferte der Takeda Pharmaceutical Company Limited zum Preis von USD 24.00 pro Aktie						09.01.		USD	0.000		0.000
17.2.2017 Fusion/Umtausch: 1 Akt. ARIAD Pharmaceuticals, Inc. von USD 0.001 nom. = USD 24.00 in bar						17.02.		USD	0.000		0.000
Ashtead Group plc, London, Grossbritannien											
Namenaktien	GBP	0.100	370 440	26.250	19.01.	08.02.		GBP	0.0475		0.05915
					17.08.	15.09.		GBP	0.2275		0.29698
ASICS Corporation, Kobe, Japan											
Namenaktien	JPY	0.000	761 515	15.350	28.12.	30.03.		JPY	23.500		0.21032
ASML Holding NV, Veldhoven, Niederlande											
Inhaberaktien	EUR	0.090	19 531 091	170.250	28.04.	12.05.		EUR	1.200		1.314
Assicurazioni Generali S.p.A., Trieste, Italien											
Namenaktien	EUR	1.00	566 030	17.780	22.05.	24.05.	26	EUR	0.800		0.87388
Associated British Foods plc, London, Grossbritannien											
Namenaktien	GBP	0.057	719 064	37.180	15.12.	13.01.		GBP	0.2645		0.32526
					08.06.	07.07.		GBP	0.1135		0.14101
11.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben											
AstraZeneca PLC, London, Grossbritannien											
Namenaktien	USD	0.250	982 352	67.660	16.02.	20.03.		GBP	1.502		1.850
					10.08.	11.09.		GBP	0.689		0.86487
AT & S Austria Technologie & Systemtechnik AG, Leoben, Österreich											
Inhaberaktien	EUR	0.000	828 998	27.540	25.07.	27.07.		EUR	0.100		0.11236
AT&T Inc., Dallas, USA											
Stammaktien	USD	1.00	2 342 429	38.730	06.01.	01.02.		USD	0.490		0.48624
					06.04.	01.05.		USD	0.490		0.48703
					06.07.	01.08.		USD	0.490		0.47317
					06.10.	01.11.		USD	0.490		0.49065
Aurubis AG, Hamburg, Deutschland											
Inhaberaktien	EUR	0.000	917 955	91.030	03.03.	07.03.		EUR	1.250		1.340
Avino Silver & Gold Mines Ltd., Vancouver, Kanada											
Namenaktien	CAD	0.000	706 643	1.330				CAD	0.000		0.000
11.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben											
AXA SA, Paris, Frankreich											
	EUR	2.29	486 352	29.090	05.05.	09.05.		EUR	1.160		1.270
Axel Springer SE, Berlin, Deutschland											
Namenaktien	EUR	0.000	1 129 251	76.370	27.04.	02.05.		EUR	1.900		2.058

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Baidu, Inc., George Town, Kaimaninseln											
Namenaktien ADR	USD	0.00005	2 231 362	230.280				USD	0.000		0.000
Baker Hughes Incorporated, Houston, USA											
Stammaktien	USD	1.00	910 918	-	02.02.	17.02.		USD	0.170		0.17017
					04.05.	19.05.		USD	0.170		0.16566
5.7.2017 Fusion/Umtausch: 1 Akt. Baker Hughes Incorporated von USD 1.00 nom. = 1 Akt. Baker Hughes, a GE Company von USD 0.0001 nom. (VN 37302591) und Spezialdividende von USD 17.50 in bar						05.07.		USD	16.500		15.938
Balfour Beatty PLC, London, Grossbritannien											
Namenaktien	GBP	0.500	372 870	3.910	20.04.	07.07.		GBP	0.018		0.02236
					05.10.	01.12.		GBP	0.012		0.01593
Ballard Power Systems Inc., Burnaby, Kanada											
Namenaktien	CAD	0.000	4 889 034	4.320				CAD	0.000		0.000
Bank of America Corporation, Charlotte, USA											
Namenaktien	USD	0.010	748 628	28.760	01.03.	31.03.		USD	0.075		0.07507
					31.05.	30.06.		USD	0.075		0.07182
					30.08.	29.09.		USD	0.120		0.1161
					30.11.	29.12.		USD	0.120		0.11693
Barclays PLC, London, Grossbritannien											
Namenaktien	GBP	0.250	1 399 446	2.680							
2.3.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					02.03.	05.04.		GBP	0.020		0.02505 (Z)
10.8.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					10.08.	18.09.		GBP	0.010		0.01299 (Z)
Barrick Gold Corporation, Toronto, Kanada											
Stammaktien	CAD	0.000	337 680	14.100	24.02.	15.03.		USD	0.030		0.03024
					29.05.	15.06.		USD	0.030		0.02924
					29.08.	15.09.		USD	0.030		0.0288
					29.11.	15.12.		USD	0.030		0.02975
BASF SE, Ludwigshafen am Rhein, Deutschland											
Namenaktien	EUR	0.000	11 450 563	107.340	15.05.	17.05.		EUR	3.000		3.273
Basler AG, Ahrensburg, Deutschland											
Inhaberaktien	EUR	0.000	207 929	228.880	18.05.	22.05.		EUR	0.740		0.80967
Bauer AG, Schrobenhausen, Deutschland											
Inhaberaktien	EUR	0.000	2 602 618	35.450	30.06.	04.07.		EUR	0.100		0.10954
Baxter International Inc., Deerfield, USA											
Stammaktien	USD	1.00	911 702	62.990	30.11.	03.01.		USD	0.130		0.13376
					01.03.	03.04.		USD	0.130		0.13039
					31.05.	03.07.		USD	0.160		0.15409
					30.08.	02.10.		USD	0.160		0.15575
Bayer AG, Leverkusen, Deutschland											
Namenaktien	EUR	0.000	10 367 293	121.540	01.05.	04.05.		EUR	2.700		2.928
Bayerische Motoren Werke AG, München, Deutschland											
Inhaberaktien	EUR	1.00	324 410	101.970	12.05.	16.05.		EUR	3.500		3.829
Vorzugsaktien	EUR	1.00	324 412	87.330	12.05.	16.05.		EUR	3.520		3.851
BayWa AG, München, Deutschland											
Namenaktien	EUR	0.000	324 583	36.820	24.05.	26.05.		EUR	0.850		0.9262

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Bechtle Aktiengesellschaft, Neckarsulm, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	1 060 508	81.790	02.06.	07.06.		EUR	1.500		1.628	
24.7.2017 B.V.: 1 alte Akt. = 1 neue (gratis {anteiliger Betrag am Grundkapital = EUR 1.00})					24.07.	24.07.		EUR	1.000		1.101	
Becton, Dickinson and Company, Franklin Lakes, USA												
Namenaktien	USD	1.00	912 061	210.370	08.03.	31.03.		USD	0.730		0.73068	
					07.06.	30.06.		USD	0.730		0.69908	
					07.09.	29.09.		USD	0.730		0.70631	
					07.12.	29.12.		USD	0.750		0.73085	
Beiersdorf AG, Hamburg, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	324 660	114.530	21.04.	25.04.		EUR	0.700		0.75971	
Berentzen-Gruppe AG, Haseluenne, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	28 834 664	9.640	22.05.	24.05.		EUR	0.250		0.27308	
Berkeley Group Holdings plc, (The), Cobham, Grossbritannien												
Namenaktien	GBP	0.050	1 938 176	56.600	02.03.	24.03.		GBP	0.8524		1.055	
					24.08.	15.09.		GBP	0.5176		0.67569	
Berkshire Hathaway Inc., Omaha, USA												
Namenaktien	USD	0.0033	10 926 529	195.240				USD	0.000		0.000	
Bertrandt AG, Ehningen, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	516 702	118.940	24.02.	28.02.		EUR	2.500		2.660	
Best Buy Co., Inc., Richfield, USA												
Namenaktien	USD	0.100	912 551	65.930	20.03.	12.04.		USD	0.340		0.34166	
					13.06.	06.07.		USD	0.340		0.32739	
					18.09.	10.10.		USD	0.340		0.33123	
					06.12.	28.12.		USD	0.340		0.33286	
bet-at-home.com AG, Duesseldorf, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	2 034 939	121.750	18.05.	22.05.		EUR	2.500		2.735	
					18.05.	22.05.		EUR	5.000		5.470	(B)
BHP Billiton Limited, Melbourne, Australien												
Namenaktien	AUD	0.000	640 390	22.680	09.03.	28.03.		AUD	0.53177		0.39941	(Z)
					07.09.	26.09.		AUD	0.52949		0.40474	(Z)
BHP Billiton Plc, London, Grossbritannien												
Namenaktien	USD	0.500	675 391	20.380	09.03.	28.03.		GBP	0.32943		0.40617	
					07.09.	26.09.		GBP	0.32593		0.42451	
BIC (Société), Clichy, Frankreich												
au porteur	EUR	3.82	512 380	107.940	22.05.	24.05.		EUR	3.450		3.768	
Bilfinger SE, Mannheim, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	325 648	45.910	25.05.	30.05.		EUR	1.000		1.090	
Biogen Inc., Cambridge, USA												
Namenaktien	USD	0.0005	1 720 684	310.430				USD	0.000		0.000	
2.2.2017 Abspaltung: 1 Akt. = 0.50 Akt. Bioverativ Inc. von USD 0.001 nom.					02.02.	01.02.		USD	0.0005		0.00049	
Biotest AG, Dreieich, Deutschland												
Vorzugsaktien ohne Stimmrecht	EUR	0.000	325 670	23.250								
18.5.2017 Kaufofferte der Tiancheng (Germany) Pharmaceutical Holdings AG zum Preis von EUR 19.00 pro Aktie					18.05.	18.05.		EUR	0.000		0.000	
					31.08.	04.09.		EUR	0.070		0.07972	
Bitcoin Group SE, Herford, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	21 320 655	73.000				EUR	0.000		0.000	

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
BlackBerry Limited, Waterloo, Kanada												
Namenaktien	CAD	0.000	21 892 856	10.910				CAD	0.000		0.000	
BlackRock, Inc., New York, USA												
Namenaktien	USD	0.010	1 005 182	499.300	02.03.	23.03.		USD	2.500		2.481	
					01.06.	23.06.		USD	2.500		2.421	
					31.08.	22.09.		USD	2.500		2.422	
					01.12.	21.12.		USD	2.500		2.472	
BNP Paribas SA, Paris, Frankreich												
	EUR	2.00	123 397	72.720	30.05.	01.06.		EUR	2.700		2.938	
Boeing Company (The), Seattle, USA												
Stammaktien	USD	5.00	913 253	289.900	08.02.	03.03.		USD	1.420		1.435	
					10.05.	02.06.		USD	1.420		1.368	
					09.08.	01.09.		USD	1.420		1.366	
					09.11.	01.12.		USD	1.420		1.397	
Bombardier Inc., Montreal, Kanada												
Namenaktien	CAD	0.000	679 353	2.350				CAD	0.000		0.000	
Borussia Dortmund GmbH & Co. KGaA, Dortmund, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	1 131 616	7.130	28.11.	30.11.	7	EUR	0.060		0.07025	(Z)
Ohne Deutsche Kapitalertragsteuer, daher keinen Anspruch auf pauschale Steueranrechnung												
Bouygues, Paris, Frankreich												
au porteur	EUR	1.00	487 662	50.670	03.05.	05.05.		EUR	1.600		1.737	
BP plc, London, Grossbritannien												
	USD	0.250	844 183	6.860								
16.2.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					16.02.	31.03.		GBP	0.08158		0.10211	(Z)
11.5.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					11.05.	23.06.		GBP	0.07756		0.09571	(Z)
10.8.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					10.08.	22.09.		GBP	0.07621		0.09989	(Z)
9.11.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					09.11.	21.12.		GBP	0.07443		0.09832	(Z)
Bpost NV van Publiek Recht, Brussel, Belgien												
Namenaktien	EUR	0.000	21 588 225	29.810	15.05.	17.05.		EUR	0.250		0.27281	
					07.12.	11.12.		EUR	1.060		1.238	
Brenntag AG, Muehlheim/Ruhr, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	11 144 071	62.210	09.06.	13.06.		EUR	1.050		1.139	
Bristol-Myers Squibb Company, New York, USA												
Namenaktien	USD	0.100	914 188	59.710	04.01.	01.02.		USD	0.390		0.387	
					05.04.	01.05.		USD	0.390		0.38764	
					05.07.	01.08.		USD	0.390		0.3766	
					05.10.	01.11.		USD	0.390		0.39052	
British American Tobacco p.l.c., London, Grossbritannien												
Namenaktien	GBP	0.250	909 525	66.750	16.03.	04.05.		GBP	1.181		1.511	
					17.08.	28.09.		GBP	0.565		0.73793	
BUWOG AG, Wien, Österreich												
Inhaberaktien	EUR	0.000	23 981 281	33.520								
19.10.2017 Ohne österreichische Kapitalertragsteuer, daher keinen Anspruch auf pauschale Steueranrechnung					19.10.	23.10.		EUR	0.690		0.79891	(Z)

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
B2Gold Corp., Vancouver, Kanada											
Namenaktien	CAD	0.000	3 600 792	2.960				CAD	0.000		0.000
14.10.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben											

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Cameco Corporation, Saskatoon, Kanada												
Namenaktien	CAD	0.000	680 579	9.250	28.12.	13.01.		CAD	0.100		0.07694	
					29.03.	13.04.		CAD	0.100		0.07574	
					28.06.	14.07.		CAD	0.100		0.07618	
					28.09.	13.10.		CAD	0.100		0.07807	
Canadian Solar Inc., Guelph, Kanada												
Namenaktien 16.10.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben	CAD	0.000	2 766 454	16.330				CAD	0.000		0.000	
CANCOM SE, München, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	883 557	81.200	21.06.	23.06.		EUR	0.500		0.54252	
Canon Inc., Tokyo, Japan												
Namenaktien	JPY	0.000	761 599	36.330	28.12.	31.03.		JPY	75.000		0.67365	
					28.06.	28.08.		JPY	75.000		0.65587	
Capgemini SE, Paris, Frankreich												
au porteur	EUR	8.00	488 070	115.710	22.05.	24.05.		EUR	1.550		1.693	
Capital Stage AG, Hamburg, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	923 850	7.490								
19.5.2017 wahlweise in bar oder in Aktien (die Gesamtdividende von EUR 0.20 setzt sich aus einem Betrag von EUR 0.1284 und EUR 0.05 {wird in bar ausbezahlt} zusammen, welche der Kapitalertragsteuer unterliegen und einem Betrag von EUR 0.0216, welcher nicht der Kapitalertragsteuer unterliegt, daher besteht bei diesem Betrag kein Anspruch auf pauschale Steueranrechnung)					19.05.	27.06.		EUR	0.0216		0.02352	(Z)
					19.05.	27.06.		EUR	0.1784		0.19428	(Q)
Carl Zeiss Meditec AG, Jena, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	1 055 489	60.600	31.05.	02.06.		EUR	0.420		0.45643	
Carlsberg A/S, Copenhagen, Dänemark												
Inhaberaktien B	DKK	20.00	461 893	117.080	31.03.	04.04.		DKK	10.000		1.435	
Carrefour SA, Boulogne-Billancourt, Frankreich												
au porteur	EUR	2.50	488 167	21.100								
21.6.2017 au choix en espèces ou en actions					21.06.	13.07.		EUR	0.700		0.77248	(Q)
Cassiopea S.p.A., Milan, Italien												
Namenaktien	EUR	1.00	28 252 872	34.800				EUR	0.000		0.000	
Caterpillar Inc., Peoria, USA												
Stammaktien	USD	1.00	916 546	153.550	18.01.	18.02.		USD	0.770		0.77166	
					20.04.	20.05.		USD	0.770		0.74898	
					18.07.	19.08.	FR0013269164	USD	0.780		0.74907	
					20.10.	20.11.	FR0013291499	USD	0.780		0.77302	
CECONOMY AG, Düsseldorf, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	492 663	14.740	07.02.	09.02.		EUR	1.000		1.067	
13.7.2017 Abspaltung: 1 Akt. = 1 Akt. METRO Wholesale & Food Specialist AG ohne Nennwert (anteiliger Betrag am Grundkapital = EUR 1.00) / (VN 37437098)					13.07.	13.07.		EUR	1.000		1.103	
Celgene Corporation, Summit, USA												
Namenaktien	USD	0.010	916 749	103.340				USD	0.000		0.000	

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
CENIT AG, Stuttgart, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	889 523	25.000	15.05.	17.05.		EUR	1.000		1.091	
CENTROTEC Sustainable AG, Brilon, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	953 194	18.100	01.06.	06.06.		EUR	0.300		0.32566	
Cerner Corporation, North Kansas City, USA												
Namenaktien	USD	0.010	917 280	66.420				USD	0.000		0.000	
25.11.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben												
CEWE Stiftung & Co. KGaA, Oldenburg, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	61 760	102.400	01.06.	06.06.		EUR	1.800		1.953	
Chevron Corporation, San Ramon, USA												
Namenaktien	USD	0.750	1 281 709	122.420	14.02.	10.03.		USD	1.080		1.090	
					17.05.	12.06.		USD	1.080		1.046	
					16.08.	11.09.		USD	1.080		1.028	
					16.11.	11.12.		USD	1.080		1.069	
China Mobile Limited, Hongkong												
Namenaktien	HKD	0.000	1 099 448	9.850	02.06.	28.06.		HKD	1.243		0.15293	
					31.08.	28.09.		HKD	1.623		0.20187	
					31.08.	28.09.		HKD	3.200		0.39802	(B)
Christian Dior SE, Paris, Frankreich												
au porteur	EUR	2.00	496 873	354.600	19.04.	21.04.		EUR	1.400		1.494	
8.6.2017 offre d'achat/d`échange: 1 act. Christian Dior SE de EUR 2.00 nom. = EUR 172.00 en espèces par action et 0.192 act. Hermès International de EUR 0.51 nom. ou EUR 266.00 en espèces par action ou 0.566 act. Hermès International de EUR 0.51 nom. (VN 86689)					08.06.	08.06.		EUR	0.000		0.000	
					05.12.	07.12.		EUR	1.600		1.873	
Church & Dwight Co., Inc., Ewing, USA												
Namenaktien	USD	1.00	918 426	49.450	16.02.	01.03.		USD	0.190		0.19169	
					12.05.	01.06.		USD	0.190		0.18419	
					11.08.	01.09.		USD	0.190		0.18289	
					14.11.	01.12.		USD	0.190		0.18698	
Cisco Systems Inc., San Jose, USA												
	USD	0.001	918 546	37.850	04.01.	25.01.		USD	0.260		0.25976	
					04.04.	26.04.		USD	0.290		0.28845	
					05.07.	26.07.		USD	0.290		0.27808	
					04.10.	25.10.		USD	0.290		0.2871	
Citigroup Inc., New York, USA												
Namenaktien	USD	0.010	12 915 350	73.300	02.02.	24.02.		USD	0.160		0.16106	
					27.04.	26.05.		USD	0.160		0.15588	
					03.08.	25.08.		USD	0.320		0.30668	
					03.11.	22.11.		USD	0.320		0.31466	
Clere AG, Berlin, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	32 290 227	14.600								
24.5.2017 Kaufofferte der Elector GmbH zum Preis von EUR 16.33 pro Aktie						24.05.		EUR	0.000		0.000	
10.8.2017 Kaufofferte der ACON Actienbank AG zum Preis von EUR 17.00 pro Aktie						10.08.		EUR	0.000		0.000	
29.6.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben					31.08.	04.09.		EUR	7.000		7.972	
CNOOC Limited, Hong Kong, Hongkong												
Namenaktien	HKD	0.020	1 778 506	1.380	08.06.	18.07.		HKD	0.230		0.02808	
					07.09.	12.10.		HKD	0.200		0.025	

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Coca-Cola Company (The), Atlanta, USA												
Stammaktien	USD	0.250	919 390	44.830	13.03.	03.04.		USD	0.370		0.37112	
					13.06.	03.07.		USD	0.370		0.35634	
					14.09.	02.10.		USD	0.370		0.36017	
					30.11.	15.12.		USD	0.370		0.36698	
Coeur Mining, Inc., Coeur d'Alene, USA												
Namenaktien	USD	0.010	10 218 771	7.300				USD	0.000		0.000	
Cognizant Technology Solutions Corporation, Teaneck, USA												
Namenaktien	USD	0.010	922 121	69.620	18.05.	31.05.		USD	0.150		0.14513	
					18.08.	31.08.		USD	0.150		0.14415	
					17.11.	30.11.		USD	0.150		0.14729	
Colgate-Palmolive Company, New York, USA												
Stammaktien	USD	1.00	919 477	73.130	19.01.	15.02.		USD	0.390		0.39328	
					19.04.	15.05.		USD	0.400		0.39865	
					14.07.	15.08.		USD	0.400		0.38914	
					20.10.	15.11.		USD	0.400		0.39588	
Coloplast A/S, Humlebaek, Dänemark												
Namenaktien	DKK	1.00	20 259 063	77.750	08.05.	10.05.		DKK	4.500		0.66281	
					08.12.	12.12.		DKK	10.500		1.642	
Comcast Corporation, Philadelphia, USA												
Namenaktien	USD	0.010	1 508 590	39.410	30.12.	25.01.		USD	0.275		0.27475	
21.2.2017 B.V.: 1 alte Akt. = 1 neue (gratis)					21.02.	17.02.		USD	0.010		0.01009	
					03.04.	26.04.		USD	0.1575		0.15666	
					30.06.	26.07.		USD	0.1575		0.15102	
					03.10.	25.10.		USD	0.1575		0.15592	
Comdirect Bank AG, Quickborn, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	1 082 188	13.190	12.05.	16.05.		EUR	0.250		0.27353	
Commerzbank AG, Frankfurt am Main, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	21 170 377	14.630				EUR	0.000		0.000	
Commonwealth Bank of Australia, Sydney, Australien												
Namenaktien	AUD	0.000	646 758	60.750	22.02.	04.04.		AUD	1.990		1.506	(Z)
					16.08.	29.09.		AUD	2.300		1.746	(Z)
Compagnie Générale de Géophysique - Veritas, Paris, Frankreich												
Stammaktien	EUR	0.800	32 269 095	4.480				EUR	0.000		0.000	
26.8.2017 cotation supprimée à SIX SX												
Compagnie Générale des Etablissements Michelin, Clermont-Ferrand, Frankreich												
nominatives	EUR	2.00	494 484	141.240	24.05.	26.05.		EUR	3.250		3.541	
CompuGroup Medical SE, Koblenz, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	224 254	63.250	11.05.	15.05.		EUR	0.350		0.38295	
ConocoPhillips, USA												
	USD	0.010	1 330 331	53.480	10.02.	01.03.		USD	0.265		0.26735	
					11.05.	01.06.		USD	0.265		0.2569	
					20.07.	01.09.		USD	0.265		0.25509	
					13.10.	01.12.		USD	0.265		0.2608	
Constellation Brands, Inc., Fairport, USA												
Namenaktien	USD	0.010	1 132 109	222.730	07.02.	23.02.		USD	0.400		0.4023	
					08.05.	24.05.		USD	0.520		0.50788	
					07.08.	23.08.		USD	0.520		0.50175	
					06.11.	21.11.		USD	0.520		0.516	

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Continental Aktiengesellschaft, Hannover, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	327 800	263.950	01.05.	04.05.		EUR	4.250		4.609	
conwert Immobilien Invest SE, Wien, Österreich												
Inhaberaktien	EUR	0.000	1 523 864	-	16.06.	20.06.		EUR	0.480		0.5212	
					25.10.	25.10.		EUR	0.000		0.000	
25.10.2017 Kaufofferte (Squeeze-out): Kaufofferte der Vonovia SE zum Preis von EUR 17.08 pro Aktie												
Corning Incorporated, Corning, USA												
Stammaktien	USD	0.500	921 667	31.720	24.02.	31.03.		USD	0.155		0.15514	
					26.05.	30.06.		USD	0.155		0.14843	
					29.08.	29.09.		USD	0.155		0.14997	
					15.11.	15.12.		USD	0.155		0.15373	
COSMO Pharmaceuticals N.V., Irland												
Namenaktien	EUR	0.260	32 590 356	146.400	29.05.	31.05.		EUR	1.500		1.632	
Covestro AG, Leverkusen, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	29 178 035	100.660	04.05.	08.05.		EUR	1.350		1.471	
Crédit Agricole S.A., Montrouge, Frankreich												
au porteur	EUR	3.00	1 336 531	16.170	29.05.	31.05.		EUR	0.600		0.6528	
CTS Eventim AG & Co. KGaA, Bremen, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	1 040 659	45.430	10.05.	12.05.		EUR	0.500		0.54762	
					10.05.	12.05.		EUR	0.480		0.52572	(B)

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Daimler AG, Stuttgart, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	945 657	82.760	30.03.	03.04.		EUR	3.250		3.472	
Danaher Corporation, Washington, USA												
Namenaktien	USD	0.010	923 916	90.450	28.12.	27.01.		USD	0.125		0.12476	
					29.03.	28.04.		USD	0.140		0.13936	
					28.06.	28.07.		USD	0.140		0.13562	
					28.09.	27.10.		USD	0.140		0.13991	
Danone, Paris, Frankreich												
5.5.2017 au choix en espèces ou en actions	EUR	0.250	487 663	81.990	05.05.	01.06.		EUR	1.700		1.850	(Q)
Dassault Systemes SE, Velizy Villacoublay, Frankreich												
au porteur 30.5.2017 au choix en espèces ou en actions	EUR	0.500	471 173	103.530	30.05.	26.06.		EUR	0.530		0.57613	(Q)
Deere & Company, Moline, USA												
Namenaktien	USD	1.00	924 235	152.510	28.12.	01.02.		USD	0.600		0.59539	
					29.03.	01.05.		USD	0.600		0.59637	
					28.06.	01.08.		USD	0.600		0.57939	
					28.09.	01.11.		USD	0.600		0.6008	
Delivery Hero AG, Berlin, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	37 200 572	38.380				EUR	0.000		0.000	
Delta Air Lines, Inc., Atlanta, USA												
Namenaktien	USD	0.0001	3 074 948	54.570	22.02.	17.03.		USD	0.2025		0.20208	
					17.05.	09.06.		USD	0.2025		0.19647	
					21.08.	13.09.		USD	0.305		0.29378	
					16.11.	08.12.		USD	0.305		0.30329	
Delticom AG, Hannover, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	2 754 216	13.190	03.05.	05.05.		EUR	0.500		0.54287	
Detour Gold Corporation, Toronto, Kanada												
Namenaktien 11.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben	CAD	0.000	2 895 664	11.090				CAD	0.000		0.000	
Deutsche Bank AG, Frankfurt am Main, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	829 257	18.550	19.05.	23.05.		EUR	0.190		0.20729	
Deutsche Beteiligungs AG, Frankfurt am Main, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	21 694 560	54.500	23.02.	27.02.		EUR	1.200		1.280	
Deutsche Börse AG, Frankfurt am Main, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	1 177 233	113.190	18.05.	22.05.		EUR	2.350		2.571	
Deutsche EuroShop AG, Hamburg, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	1 137 569	39.720	29.06.	03.07.		EUR	0.600		0.65691	
Ohne deutsche Kapitalertragsteuer, daher keinen Anspruch auf pauschale Steueranrechnung					29.06.	03.07.		EUR	0.800		0.87588	(Z)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Deutsche Lufthansa AG, Köln, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	667 979	36.050								
8.5.2017 wahlweise in bar oder in Aktien (von der Gesamtdividende im Betrag von EUR 0.50 hatten die Aktionäre die Möglichkeit, den Betrag von EUR 0.35 in bar oder in Aktien zu beziehen; die Gesamtdividende im Betrag von EUR 0.50 unterliegt der Kapitalertragsteuer, daher besteht Anspruch auf pauschale Steueranrechnung)					08.05.	06.06.		EUR	0.500		0.54277	(Q)
Deutsche Pfandbriefbank AG, München, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	324 330	15.630	31.05.	02.06.		EUR	1.050		1.141	
Deutsche Post AG, Bonn, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	1 124 244	46.530								
2.5.2017 Ohne deutsche Kapitalertragsteuer, daher keinen Anspruch auf pauschale Steueranrechnung					02.05.	04.05.		EUR	1.050		1.138	(Z)
Deutsche Telekom AG, Bonn, Deutschland												
	EUR	0.000	1 026 592	17.310								
1.6.2017 wahlweise in bar oder in Aktien (ohne deutsche Kapitalertragsteuer, daher keinen Anspruch auf pauschale Steueranrechnung)					01.06.	28.06.		EUR	0.600		0.65463	(Z)
Deutsche Wohnen SE, Frankfurt am Main, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	2 454 186	42.060	05.06.	07.06.		EUR	0.340		0.36905	
Ohne deutsche Kapitalertragsteuer, daher keinen Anspruch auf pauschale Steueranrechnung					05.06.	07.06.		EUR	0.400		0.43418	(Z)
Deutz AG, Köln, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	338 580	8.850								
Ohne deutsche Kapitalertragsteuer, daher keinen Anspruch auf pauschale Steueranrechnung					05.05.	09.05.		EUR	0.070		0.07664	(Z)
DIC ASSET AG, Frankfurt am Main, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	22 161 657	12.090	12.07.	14.07.		EUR	0.12008		0.1327	
Ohne Deutsche Kapitalertragsteuer, daher keinen Anspruch auf pauschale Steueranrechnung					12.07.	14.07.		EUR	0.27991		0.30931	(Z)
Diebold Nixdorf AG, Paderborn, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	1 857 256	85.520	24.01.	26.01.		EUR	1.710		1.825	
15.2.2017 Kaufofferte der Diebold Holding Germany Inc. & Co. KGaA, Eschborn, zum Preis von EUR 55.02 pro Aktie					15.02.	15.02.		EUR	0.000		0.000	
DMG MORI AKTIENGESELLSCHAFT, Bielefeld, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	117 202	53.570	08.05.	10.05.		EUR	1.030		1.128	

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Dow Chemical Company, (The), Midland, USA												
Stammaktien	USD	2.50	925 686	-	23.12.	30.01.		USD	0.460		0.45868	
					29.03.	28.04.		USD	0.460		0.4579	
					28.06.	28.07.		USD	0.460		0.4456	
1.9.2017 Fusion/Umtausch: 1 Akt. Dow Chemical Company, (The) von USD 2.50 nom. = 1 Akt. DowDuPont Inc. von USD 0.01 nom. (VN 37575522)						01.09.		USD	0.000		0.000	
					27.07.	02.10.		USD	0.460		0.44779	
Drägerwerk AG & Co. KGaA, Lübeck, Deutschland												
Vorz.Akt. ohne Stimmrecht	EUR	0.000	330 446	84.890	11.05.	15.05.		EUR	0.190		0.20788	
Drillisch AG, Maintal, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	868 900	80.540	19.05.	23.05.		EUR	1.800		1.963	
26.5.2017 Kaufofferte der United Internet AG zum Preis von EUR 50.00 pro Aktie					26.05.	26.05.		EUR	0.000		0.000	
DSM (Koninklijke) N.V., Heerlen, Niederlande												
	EUR	1.50	2 542 581	93.750								
5.5.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					05.05.	26.05.		EUR	1.200		1.307	(V)
3.8.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					03.08.	24.08.		EUR	0.580		0.66044	(V)
Du Pont de Nemours (E.I.) & Co., Wilmington, USA												
Stammaktien	USD	0.300	927 399	-	13.02.	14.03.		USD	0.380		0.38294	
					11.05.	12.06.		USD	0.380		0.36827	
1.9.2017 Fusion/Umtausch: 1 Akt. Du Pont de Nemours (E.I.) & Co. von USD 0.30 nom. = 1.282 Akt. DowDuPont Inc. von je USD 0.01 nom. (VN 37575522)						01.09.		USD	0.000		0.000	
					27.07.	29.09.		USD	0.380		0.36767	
Duerr AG, Stuttgart, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	354 848	124.150	08.05.	10.05.		EUR	2.100		2.301	

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
eBay Inc., San Jose, USA											
	USD	0.001	956 191	36.940				USD	0.000		0.000
Edwards Lifesciences Corporation, Irvine, USA											
Namenaktien	USD	1.00	1 065 343	109.830				USD	0.000		0.000
Eldorado Gold Corporation, Vancouver, Kanada											
Namenaktien	USD	0.000	545 937	1.380	03.03.	16.03.		CAD	0.020		0.01494
14.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben											
Électricité de France SA, Paris, Frankreich											
au porteur	EUR	0.500	2 321 068	12.200							
6.6.2017 au choix en espèces ou en actions					06.06.	30.06.		EUR	0.400		0.4369 (Q)
16.11.2017 au choix en espèces ou en actions					16.11.	11.12.		EUR	0.150		0.17526 (Q)
ElringKlinger AG, Dettingen/ Erms, Deutschland											
Namenaktien	EUR	0.000	1 358 142	21.840	17.05.	19.05.		EUR	0.500		0.54547
Emerson Electric Co., St. Louis, USA											
Namenaktien	USD	0.500	928 215	67.910	15.02.	10.03.		USD	0.480		0.48488
					10.05.	09.06.		USD	0.480		0.4657
					09.08.	11.09.		USD	0.480		0.45696
					16.11.	11.12.		USD	0.485		0.48043
Endeavour Silver Corp., Vancouver, Kanada											
Namenaktien	CAD	0.000	1 935 513	2.370				CAD	0.000		0.000
14.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben											
ENEL Ente Nazionale per l'Energia Elettrica S.p.A., Rom, Italien											
Namenaktien	EUR	1.00	1 250 633	6.030	23.01.	25.01.	25	EUR	0.090		0.09659
					24.07.	26.07.	26	EUR	0.090		0.10037
Engie SA, Paris, Frankreich											
au porteur	EUR	1.00	2 200 367	16.800	16.05.	18.05.		EUR	0.500		0.54432
					11.10.	13.10.		EUR	0.350		0.40365
Eni S.p.A., Rom, Italien											
Namenaktien	EUR	0.000	1 252 314	16.240	24.04.	26.04.	28	EUR	0.400		0.43274
					18.09.	20.09.	29	EUR	0.400		0.46152
Enphase Energy, Inc., Petaluma, USA											
Namenaktien	USD	0.00001	13 213 821	2.340				USD	0.000		0.000
11.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben											
E.ON SE, Essen, Deutschland											
Namenaktien	EUR	0.000	4 334 819	10.630							
11.5.2017 wahlweise in bar oder in Aktien (von der Gesamtdividende im Betrag von EUR 0.21 hatten die Aktionäre die Möglichkeit, den Betrag von EUR 0.15 in bar oder in Aktien zu beziehen; die Gesamtdividende im Betrag von EUR 0.21 unterliegt der Kapitalertragsteuer, daher besteht Anspruch auf pauschale Steueranrechnung)					11.05.	07.06.		EUR	0.210		0.22794 (Q)
Ericsson (Telefonaktiebolaget LM), Stockholm, Schweden											
	SEK	0.000	614 663	6.420	30.03.	05.04.		SEK	1.000		0.11189
Erste Group Bank AG, Wien, Österreich											
Inhaberaktien	EUR	0.000	728 952	42.000							
23.5.2017 Ohne österreichische Kapitalertragsteuer, daher keinen Anspruch auf pauschale Steueranrechnung					23.05.	26.05.		EUR	1.000		1.089 (Z)

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Essilor International S.A., Charenton-le-Pont, Frankreich											
au porteur	EUR	0.180	497 537	134.500	17.05.	19.05.		EUR	1.500		1.636
Eurofins Scientific SE, Luxemburg											
au porteur	EUR	0.100	719 177	582.730	29.06.	03.07.		EUR	2.000		2.189
EVN AG, Maria Enzersdorf, Österreich											
Inhaberaktien	EUR	0.000	428 837	19.520	25.01.	27.01.		EUR	0.420		0.44879
Evonik Industries AG, Essen, Deutschland											
Namenaktien	EUR	0.000	18 699 457	36.330	24.05.	29.05.		EUR	1.150		1.254
Evotec AG, Hamburg, Deutschland											
Inhaberaktien	EUR	0.000	505 433	15.840				EUR	0.000		0.000
Exar Corporation, Fremont, USA											
Namenaktien	USD	0.0001	928 988	-				USD	0.000		0.000
29.3.2017 Kaufofferte der Eagle Acquisition Corporation zum Preis von USD 13.00 pro Aktie						29.03.		USD	0.000		0.000
12.5.2017 Fusion/Umtausch: 1 Akt. Exar Corporation von USD 0.0001 nom. = USD 13.00 in bar						12.05.		USD	0.000		0.000
ExOne Company, (The), North Huntingdon, USA											
Namenaktien	USD	0.010	20 568 145	8.180				USD	0.000		0.000
23.10.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben											
Expedia, Inc., Bellevue, USA											
Namenaktien	USD	0.0001	14 491 617	110.500	07.03.	30.03.		USD	0.280		0.27891
					23.05.	15.06.		USD	0.280		0.27295
					22.08.	14.09.		USD	0.300		0.29006
					15.11.	07.12.		USD	0.300		0.29791
Experian plc, St Hellier, Jersey											
Namenaktien	USD	0.100	2 650 919	21.560	29.12.	27.01.		GBP	0.10552		0.13217
					22.06.	21.07.		GBP	0.2194		0.27001
Express Scripts Holding Company, Saint Louis, USA											
Namenaktien	USD	0.010	18 101 483	72.450				USD	0.000		0.000
Exxon Mobil Corporation, Irving, USA											
	USD	0.000	808 963	81.930	08.02.	10.03.		USD	0.750		0.75763
15.3.2017 Kaufofferte: TRC Capital Corp zu USD 78.00						14.03.		USD	0.000		0.000
					10.05.	09.06.		USD	0.770		0.74707
					10.08.	11.09.		USD	0.770		0.73305
					10.11.	11.12.		USD	0.770		0.76275

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Facebook, Inc., Menlo Park, USA												
Namenaktien	USD	0.000006	14 917 609	171.950				USD	0.000		0.000	
Faurecia SA, Nanterre, Frankreich												
au porteur	EUR	7.00	487 591	76.570	02.06.	06.06.		EUR	0.900		0.97699	
Fedex Corporation, Memphis, USA												
Namenaktien	USD	0.100	1 039 039	243.170	08.12.	03.01.		USD	0.400		0.41157	
					09.03.	03.04.		USD	0.400		0.40122	
					20.06.	06.07.		USD	0.500		0.48145	
					08.09.	02.10.		USD	0.500		0.48672	
Ferrari N.V., Amsterdam, Niederlande												
Namenaktien	EUR	0.010	30 827 865	103.100	24.04.	02.05.		EUR	0.635		0.68802	
Fielmann AG, Hamburg, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	280 923	85.880	02.06.	07.06.		EUR	1.800		1.953	
FireEye, Inc., Milpitas, USA												
Namenaktien 11.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben	USD	0.0001	22 067 647	13.830				USD	0.000		0.000	
First Majestic Silver Corp., Vancouver, Kanada												
Namenaktien 14.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben	CAD	0.000	2 723 324	6.720				CAD	0.000		0.000	
First Solar, Inc., Tempe, USA												
Namenaktien	USD	0.001	2 626 060	65.790				USD	0.000		0.000	
Ford Motor Company, Dearborn, USA												
Stammaktien	USD	0.010	1 106 820	12.170	18.01.	01.03.		USD	0.050		0.05044	(B)
					18.01.	01.03.		USD	0.150		0.15133	
					18.04.	01.06.		USD	0.150		0.14541	
					20.07.	01.09.		USD	0.150		0.14439	
					20.10.	01.12.		USD	0.150		0.14762	
Formulafirst Ltd., Tortola, Britische Jungferninseln												
	CHF	0.010	1 462 983	33.000				CHF			0.000	
Fortuna Silver Mines Inc., Vancouver, Kanada												
Namenaktien 14.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben	CAD	0.000	997 460	5.150				CAD	0.000		0.000	
Franco-Nevada Corporation, Toronto, Kanada												
Namenaktien	CAD	0.000	3 590 522	78.130	14.03.	30.03.		USD	0.220		0.21914	
					13.06.	29.06.		USD	0.230		0.22007	
					13.09.	28.09.		USD	0.230		0.22342	
					06.12.	21.12.		USD	0.230		0.22749	
14.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben												
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide, Frankfurt am Main, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	1 234 108	107.460	24.05.	29.05.		EUR	1.500		1.636	
freenet AG, Büdelsdorf, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	10 575 025	36.050								
Ohne deutsche Kapitalertragsteuer, daher keinen Anspruch auf pauschale Steueranrechnung					02.06.	06.06.		EUR	1.600		1.736	(Z)
Freeport-McMoRan Inc., Phoenix, USA												
Namenaktien	USD	0.100	391 280	18.470				USD	0.000		0.000	

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA, Bad Homburg v. d. Höhe, Deutschland											
Inhaberaktien	EUR	0.000	520 878	102.710	12.05.	16.05.		EUR	0.960		1.050
Fresenius SE & Co. KGaA, Bad Homburg v. d. Höhe, Deutschland											
Inhaberaktien	EUR	0.000	332 902	75.840	15.05.	17.05.		EUR	0.620		0.67657
Fuchs Petrolub SE, Mannheim, Deutschland											
Vorzugsaktien	EUR	0.000	333 000	52.180	08.05.	10.05.		EUR	0.890		0.97548
FuelCell Energy, Inc., Danbury, USA											
Namenaktien 11.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben	USD	0.0001	30 688 971	1.680				USD	0.000		0.000

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Gagfah S.A., Luxemburg												
Namenaktien	EUR	1.25	2 741 329	-				EUR	0.000		0.000	
12.7.2017 Fusion/Umtausch: 100 Akt. Gagfah S.A. von je EUR 1.25 nom. = 57 Akt. Vonovia SE ohne Nennwert (anteiliger Betrag: EUR 1.00) / (VN 21644750)					12.07.	12.07.		EUR	0.000		0.000	
Galaxy Entertainment Group Ltd, Kwun Tong, Hongkong												
Namenaktien	HKD	0.000	2 281 095	7.690	27.03.	28.04.		HKD	0.260		0.03327	(B)
					25.09.	27.10.		HKD	0.330		0.04226	(B)
GEA Group AG, Düsseldorf, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	360 133	46.610								
21.4.2017 Ohne Deutsche Kapitalertragsteuer, daher keinen Anspruch auf pauschale Steueranrechnung					21.04.	25.04.		EUR	0.800		0.86824	(Z)
Gecina, Paris, Frankreich												
nominatives	EUR	7.50	1 753 313	180.080	06.03.	08.03.		EUR	2.600		2.784	
					05.07.	07.07.		EUR	2.600		2.856	
Gemalto N.V., Amsterdam, Niederlande												
Inhaberaktien	EUR	1.00	1 855 654	57.920	22.05.	24.05.		EUR	0.500		0.54617	
11.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben												
General Electric Company, Fairfield, USA												
Stammaktien	USD	0.060	933 071	16.900	22.12.	25.01.		USD	0.240		0.23978	
					23.02.	25.04.		USD	0.240		0.23839	
					15.06.	25.07.	FR0013262706	USD	0.240		0.22771	
					15.09.	25.10.	FR0013283207	USD	0.240		0.2376	
General Mills, Inc., Minneapolis, USA												
Namenaktien	USD	0.100	933 225	57.770	06.01.	01.02.		USD	0.480		0.47631	
					06.04.	01.05.		USD	0.480		0.47709	
					06.07.	01.08.		USD	0.490		0.47317	
					06.10.	01.11.		USD	0.490		0.49065	
General Motors Company, Detroit, USA												
Namenaktien	USD	0.010	11 665 971	39.940	08.03.	24.03.		USD	0.380		0.37665	
					07.06.	23.06.		USD	0.380		0.36814	
					07.09.	22.09.		USD	0.380		0.36817	
					07.12.	21.12.		USD	0.380		0.37586	
Gerresheimer AG, Düsseldorf, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	3 138 496	80.110	27.04.	02.05.		EUR	1.050		1.137	
Gerry Weber International AG, Halle, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	1 637 445	11.160	28.04.	03.05.		EUR	0.250		0.2703	
GESCO AG, Wuppertal, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	13 790 258	35.560	01.09.	05.09.		EUR	0.350		0.39891	
Getlink SE, Paris, Frankreich												
au porteur	EUR	0.400	3 469 403	12.540	24.05.	26.05.		EUR	0.260		0.2833	
GfK AG, Nürnberg, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	504 146	-				EUR	0.000		0.000	
17.10.2017 Kaufofferte (Squeeze-out): Kaufofferte der Acceleratio Capital N.V. zum Preis von EUR 46.08 pro Aktie					17.10.	17.10.		EUR	0.000		0.000	
Gilead Sciences, Inc., Foster City, USA												
Namenaktien	USD	0.001	935 700	70.960	14.03.	30.03.		USD	0.520		0.51798	
					14.06.	29.06.		USD	0.520		0.49756	
					14.09.	28.09.		USD	0.520		0.50513	
					14.12.	28.12.		USD	0.520		0.50908	

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Glanbia plc, Kilkenny, Irland											
Namenaktien	EUR	0.060	558 678	17.430	16.03.	28.04.		EUR	0.0794		0.08606
					24.08.	06.10.		EUR	0.0591		0.06781
GlaxoSmithKline plc, Brentfort, Grossbritannien											
Namenaktien	GBP	0.250	1 102 657	17.550	03.11.	12.01.		GBP	0.190		0.23404
					23.02.	13.04.		GBP	0.230		0.28928
					11.05.	13.07.		GBP	0.190		0.23779
					10.08.	12.10.		GBP	0.190		0.24419
Glu Mobile Inc., San Francisco, USA											
Namenaktien	USD	0.0001	2 849 434	3.540				USD	0.000		0.000
11.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben											
Gold Fields Limited, Johannesburg, Südafrika											
Stammaktien	ZAR	0.500	803 185	4.100	08.03.	13.03.		ZAR	0.600		0.04606
					06.09.	11.09.		ZAR	0.400		0.02943
Gold Standard Ventures Corp., Vancouver, Kanada											
Namenaktien	CAD	0.000	10 751 439	1.710				CAD	0.000		0.000
11.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben											
Goldcorp Inc., Vancouver, Kanada											
Namenaktien	CAD	0.000	1 150 274	12.460	14.03.	24.03.		USD	0.020		0.01982
					13.06.	23.06.		USD	0.020		0.01937
					13.09.	22.09.		USD	0.020		0.01937
					13.12.	22.12.		USD	0.020		0.01979
Goldman Sachs Group, Inc., New York, USA											
Namenaktien	USD	0.010	714 968	248.250	28.02.	30.03.		USD	0.650		0.64748
					30.05.	29.06.		USD	0.750		0.71764
					29.08.	28.09.		USD	0.750		0.72855
					29.11.	28.12.		USD	0.750		0.73426
Goodyear Tire & Rubber Company, Akron, USA											
Stammaktien	USD	0.000	935 430	31.920	30.01.	01.03.		USD	0.100		0.10089
					27.04.	01.06.		USD	0.100		0.09694
					28.07.	01.09.		USD	0.100		0.09626
					31.10.	01.12.		USD	0.140		0.13778
GoPro, Inc., San Mateo, USA											
Namenaktien	USD	0.0001	24 472 334	7.630				USD	0.000		0.000
Grammer AG, Amberg, Deutschland											
Inhaberaktien	EUR	0.000	494 946	60.730	25.05.	29.05.		EUR	1.300		1.418
Grand City Properties S.A., Luxemburg											
Inhaberaktien	EUR	0.100	18 698 480	22.990	29.06.	03.07.		EUR	0.6825		0.74723
Great Portland Estates plc, London, Grossbritannien											
Namenaktien	GBP	0.125	1 881 559	n.v.							
GRENKE AG, Baden-Baden, Deutschland											
Namenaktien	EUR	0.000	28 741 392	91.900	12.05.	16.05.		EUR	1.750		1.914
24.5.2017 Gratisnennwerterhöhung: 1 Akt. ohne Nennwert (anteiliger Betrag: EUR 1.2782) = 1 Akt. ohne Nennwert (anteiliger Betrag: EUR 3.00)					24.05.	24.05.		EUR	1.721		1.880
10.7.2017 Aufteilung: 1 Akt. ohne Nennwert (anteiliger Betrag: EUR 3.00) = 3 Akt. ohne Nennwert (anteiliger Betrag: EUR 1.00)					10.07.	10.07.		EUR	0.000		0.000

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
GROUPE GORGE SA, Paris, Frankreich											
au porteur 11.9.2017 cotation supprimée à SIX SX	EUR	1.00	852 630	18.330				EUR	0.000		0.000
Groupon, Inc., Chicago, USA											
Namenaktien 11.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben	USD	0.0001	13 147 708	4.960				USD	0.000		0.000

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
H & M Hennes & Mauritz AB, Stockholm, Schweden												
	SEK	0.000	613 906	20.270	11.05.	17.05.		SEK	4.900		0.54856	
					13.11.	17.11.		SEK	4.850		0.56858	
Halliburton Company, Houston, USA												
	USD	2.50	937 414	47.820				USD				(I)
					27.02.	22.03.		USD	0.180		0.17816	
					05.06.	28.06.		USD	0.180		0.17283	
					01.09.	27.09.		USD	0.180		0.17545	
					06.12.	28.12.		USD	0.180		0.17622	
Hamburger Hafen und Logistik AG, Hamburg, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	3 513 030	27.690	22.06.	26.06.		EUR	0.590		0.64135	
Hannover Rück SE, Hannover, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	1 115 829	122.740	11.05.	15.05.		EUR	3.500		3.829	
					11.05.	15.05.		EUR	1.500		1.641	(B)
Hapag-Lloyd AG, Hamburg, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	29 897 750	39.200				EUR	0.000		0.000	
Harley-Davidson, Inc., Milwaukee, USA												
Namenaktien	USD	0.010	937 735	49.580	13.02.	03.03.		USD	0.365		0.36887	
					23.05.	09.06.		USD	0.365		0.35413	
					11.09.	22.09.		USD	0.365		0.35364	
					14.12.	29.12.		USD	0.365		0.35568	
11.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben												
HAWESKO Holding AG, Hamburg, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	893 434	59.670	20.06.	22.06.		EUR	1.300		1.410	
Hays plc, London, Grossbritannien												
Namenaktien	GBP	0.010	387 881	2.410	02.03.	07.04.		GBP	0.0096		0.01197	
					05.10.	17.11.		GBP	0.0425		0.0556	(B)
					05.10.	17.11.		GBP	0.0226		0.02956	
Hecla Mining Company, Coeur d'Alene, USA												
Namenaktien	USD	0.250	938 298	3.860	02.03.	13.03.		USD	0.0025		0.00251	
					22.05.	02.06.		USD	0.0025		0.0024	
					21.08.	31.08.		USD	0.0025		0.0024	
					20.11.	01.12.		USD	0.0025		0.00246	
HeidelbergCement AG, Heidelberg, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	335 740	105.890		15.05.		EUR	1.600		1.750	
Heidelberger Druckmaschinen AG, Heidelberg, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	682 694	3.340				EUR	0.000		0.000	
Heineken NV, Amsterdam, Niederlande												
	EUR	1.60	1 804 984	101.990	24.04.	03.05.		EUR	0.820		0.88658	
					02.08.	10.08.		EUR	0.540		0.61157	
HELLA GmbH & Co. KGaA, Lippstadt, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	1.00	25 974 740	60.340	29.09.	03.10.		EUR	0.920		1.053	
Henkel AG & Co. KGaA, Düsseldorf, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	335 914	117.070	07.04.	11.04.	30	EUR	1.600		1.711	
Vorz.-Akt. Stimmrechtslos	EUR	0.000	335 910	128.950	07.04.	11.04.	30	EUR	1.620		1.732	
Hochtief AG, Essen, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	336 340	170.560	11.05.	06.07.		EUR	2.600		2.855	
Home Depot, Inc., Atlanta, USA												
Namenaktien	USD	0.050	939 360	184.690	07.03.	23.03.		USD	0.890		0.88327	
					30.05.	15.06.		USD	0.890		0.86761	
					29.08.	14.09.		USD	0.890		0.86053	
					29.11.	14.12.		USD	0.890		0.88119	

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Hornbach Holding AG & Co. KGaA, Neustadt an der Weinstrasse, Deutschland											
Inhaberaktien	EUR	0.000	1 944 196	86.610	10.07.	12.07.		EUR	1.500		1.651
HP Inc., Palo Alto, USA											
Namenaktien	USD	0.010	29 968 910	20.550	12.12.	04.01.		USD	0.1327		0.13584
					06.03.	05.04.		USD	0.1327		0.13322
					12.06.	05.07.		USD	0.1327		0.12818
					12.09.	04.10.		USD	0.1327		0.12927
Hugo Boss AG, Metzingen, Deutschland											
Namenaktien	EUR	0.000	18 789 679	83.910	24.05.	29.05.		EUR	2.600		2.836
HYPOPORT AG, Berlin, Deutschland											
Namenaktien	EUR	0.000	3 521 872	170.310				EUR	0.000		0.000

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Iamgold Corporation, Toronto, Kanada												
Namenaktien	USD	0.000	439 818	5.640				USD	0.000		0.000	
Immofinanz AG, Wien, Österreich												
Inhaberaktien	EUR	0.000	748 833	2.510								
2.6.2017 Ohne österreichische Kapitalertragsteuer, daher keinen Anspruch auf pauschale Steueranrechnung					02.06.	07.06.		EUR	0.060		0.06512	(Z)
Imperial Brands PLC, Bristol, Grossbritannien												
Namenaktien	GBP	0.100	517 719	42.000	16.02.	31.03.		GBP	0.541		0.67715	
					18.05.	30.06.		GBP	0.2585		0.32156	
					17.08.	29.09.		GBP	0.2585		0.33556	
					16.11.	29.12.		GBP	0.5951		0.78449	
INDUS Holding AG, Bergisch Gladbach, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	407 618	68.950	25.05.	29.05.		EUR	1.350		1.473	
Infineon Technologies AG, Neubiberg, Deutschland												
	EUR	0.000	1 038 049	26.790								
17.2.2017 Ohne Deutsche Kapitalertragsteuer, daher keinen Anspruch auf pauschale Steueranrechnung					17.02.	21.02.		EUR	0.220		0.23402	(Z)
ING Groep N.V., Amsterdam, Niederlande												
Namenaktien	EUR	0.010	33 292 346	17.980	10.05.	18.05.		EUR	0.420		0.45723	
					04.08.	14.08.		EUR	0.240		0.27435	
Ingenico Group S.A., Paris, Frankreich												
au porteur	EUR	1.00	495 497	104.150								
17.5.2017 au choix en espèces ou en actions					17.05.	12.06.		EUR	1.500		1.628	(Q)
Innate Pharma S.A., Marseille, Frankreich												
Stammaktien	EUR	0.050	2 554 736	5.500				EUR	0.000		0.000	
innogy SE, Essen, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	33 762 743	39.000								
25.4.2017 Ohne Deutsche Kapitalertragsteuer, daher keinen Anspruch auf pauschale Steueranrechnung					25.04.	27.04.		EUR	1.600		1.729	(Z)
Intel Corporation, Santa Clara, USA												
Stammaktien	USD	0.001	941 595	45.190	03.02.	01.03.		USD	0.260		0.26231	
					03.05.	01.06.		USD	0.2725		0.26417	
					03.08.	01.09.		USD	0.2725		0.26231	
					06.11.	01.12.		USD	0.2725		0.26818	
International Business Machines Corporation, Armonk, USA												
Stammaktien	USD	0.200	941 800	151.180	08.02.	10.03.		USD	1.400		1.414	
					08.05.	10.06.		USD	1.500		1.453	
2.8.2017 Kaufofferte der Baker Mills Inc. zum Preis von USD 130.00 pro Aktie						02.08.		USD	0.000		0.000	
					08.08.	09.09.		USD	1.500		1.428	
					09.11.	09.12.		USD	1.500		1.485	
Intertek Group PLC, London, Grossbritannien												
Namenaktien	GBP	0.010	1 428 658	68.410	18.05.	02.06.		GBP	0.430		0.5339	
					28.09.	13.10.		GBP	0.235		0.30467	
Intesa Sanpaolo S.p.A., Torino/ Milano, Italien												
Namenaktien	EUR	0.520	575 913	3.230	22.05.	24.05.		EUR	0.098		0.10705	
					22.05.	24.05.		EUR	0.080		0.08738	

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Intuitive Surgical, Inc., Sunnyvale, USA											
Namenaktien	USD	0.001	1 631 646	359.150				USD	0.000		0.000
6.10.2017 B.V.: 1 alte Akt. = 2 neue (gratis)					06.10.	05.10.		USD	0.002		0.00195
InvenSense, Inc., San Jose, USA											
Namenaktien	USD	0.001	13 582 091	-				USD	0.000		0.000
18.5.2017 Fusion/Umtausch: 1 Akt. InvenSense, Inc. von USD 0.001 = USD 13.00 in bar						18.05.		USD	0.000		0.000
Investor AB, Stockholm, Schweden											
Namenaktien	SEK	6.25	613 968	44.520	04.05.	10.05.		SEK	11.000		1.245
Ionis Pharmaceuticals, Inc., Carlsbad, USA											
Namenaktien	USD	0.001	30 877 188	49.010				USD	0.000		0.000
23.8.2017 Kaufofferte der TRC Capital Corporation zum Preis von USD 44.88 pro Aktie						23.08.		USD	0.000		0.000
Ipsos SA, Paris, Frankreich											
au porteur	EUR	0.250	821 324	36.130	03.07.	05.07.		EUR	0.850		0.93019
25.11.2017 cotation supprimée à SIX SX											
iRobot Corporation, Bedford, USA											
Namenaktien	USD	0.010	2 264 811	75.650				USD	0.000		0.000
Isra Vision AG, Darmstadt, Deutschland											
Inhaberaktien	EUR	0.000	1 071 742	248.770	16.03.	20.03.		EUR	0.480		0.51444

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
J. C. Penney Company, Inc., Plano, USA												
Namenaktien	USD	0.500	961 140	3.170				USD	0.000		0.000	
25.11.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben												
JA Solar Holdings Co., Ltd., Kaimaninseln												
Namenaktien	USD	0.0001	20 129 305	7.330				USD	0.000		0.000	
ADR 16.10.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben												
Jenoptik AG, Jena, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	884 386	32.510								
8.6.2017 Ohne deutsche Kapitalertragsteuer, daher keinen Anspruch auf pauschale Steueranrechnung					08.06.	12.06.		EUR	0.250		0.27141	(Z)
JinkoSolar Holdings Co., Ltd., Grand Cayman, Kaimaninseln												
Namenaktien	USD	0.00002	11 035 900	24.180				USD	0.000		0.000	
ADR												
Johnson & Johnson, New Brunswick, USA												
	USD	1.00	943 981	138.030	24.02.	14.03.		USD	0.800		0.8062	
					25.05.	13.06.		USD	0.840		0.81331	
					25.08.	12.09.		USD	0.840		0.80612	
					27.11.	12.12.		USD	0.840		0.83376	
JPMorgan Chase & Co., New York, USA												
Namenaktien	USD	1.00	1 161 460	105.310	04.01.	31.01.		USD	0.480		0.47355	
					04.04.	30.04.		USD	0.500		0.49697	
					03.07.	31.07.		USD	0.500		0.48244	
					05.10.	31.10.		USD	0.560		0.55819	
JSW Steel Limited, Mumbai, Indien												
Namenaktien	INR	10.00	2 071 921	-				INR	0.000		0.000	
4.1.2017 Aufteilung: 1 Akt. von INR 10.00 nom. = 10 Akt. von je INR 1.00 nom.					04.01.	04.01.		INR	0.000		0.000	
Jungheinrich AG, Hamburg, Deutschland												
Vorzugsaktien	EUR	0.000	337 639	45.400	17.05.	19.05.		EUR	0.440		0.48001	

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Kandi Technologies Group, Inc., Henderson, USA												
Namenaktien	USD	0.001	3 364 227	6.730				USD	0.000		0.000	
16.10.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben												
Kellogg Company, Battle Creek, USA												
Namenaktien	USD	0.250	944 624	66.240	27.02.	15.03.		USD	0.520		0.5242	
					30.05.	15.06.		USD	0.520		0.50691	
					30.08.	15.09.		USD	0.540		0.51855	
					30.11.	15.12.		USD	0.540		0.53559	
Kering, Paris, Frankreich												
au porteur	EUR	4.00	21 591	459.860	16.01.	18.01.		EUR	1.500		1.606	
					03.05.	05.05.		EUR	3.100		3.365	
Kimberly-Clark Corporation, Dallas, USA												
Namenaktien	USD	1.25	945 034	117.030	07.12.	04.01.		USD	0.920		0.94182	
					08.03.	04.04.		USD	0.970		0.9715	
					07.06.	05.07.		USD	0.970		0.93699	
					07.09.	03.10.		USD	0.970		0.94462	
Kingfisher plc, London, Grossbritannien												
Namenaktien	GBP	0.157	1 626 624	4.390	04.05.	19.06.		GBP	0.0715		0.08883	
					05.10.	10.11.		GBP	0.0333		0.04379	
Kinross Gold Corporation, Toronto, Kanada												
Namenaktien	CAD	0.000	1 977 416	4.210				CAD	0.000		0.000	
KION GROUP AG, Wiesbaden, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	21 642 770	83.500	12.05.	16.05.		EUR	0.800		0.87532	
Klöckner & Co SE, Duisburg, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	2 597 667	12.030	15.05.	17.05.		EUR	0.200		0.21825	
König & Bauer AG, Würzburg, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	338 875	73.520								
24.5.2017 Ohne Deutsche Kapitalertragsteuer, daher keinen Anspruch auf pauschale Steueranrechnung					24.05.	26.05.		EUR	0.500		0.54482	(Z)
Kontron AG, Eching, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	1 469 452	-				EUR				(I)
KPN NV (Koninklijke), Den Haag, Niederlande												
	EUR	0.040	1 076 509	3.400	18.04.	21.04.		EUR	0.067		0.07162	
					17.05.	22.05.		EUR	0.017		0.0186	(B)
					28.07.	02.08.		EUR	0.037		0.04243	
Krones AG, Neutraubling, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	945 454	133.950	21.06.	23.06.		EUR	1.550		1.681	
K+S Aktiengesellschaft, Kassel, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	13 421 328	24.260	11.05.	15.05.		EUR	0.300		0.32824	
KTM Industries AG, Wels, Österreich												
Inhaberaktien	EUR	0.000	504 289	7.390	02.05.	04.05.		EUR	0.030		0.03253	
KUKA Aktiengesellschaft, Augsburg, Deutschland												
	EUR	0.000	337 261	141.760	01.06.	06.06.		EUR	0.500		0.54277	
KWS SAAT SE, Einbeck, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	338 540	390.830	15.12.	19.12.		EUR	3.200		3.732	

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Lagardere SCA, Paris, Frankreich												
nominatives	EUR	6.10	24 495	31.230	08.05.	10.05.		EUR	1.300		1.424	
LANXESS AG, Leverkusen, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	2 046 021	77.670	29.05.	31.05.		EUR	0.700		0.7616	
Las Vegas Sands Corp., Las Vegas, USA												
Namenaktien	USD	0.001	1 946 078	67.710	21.03.	31.03.		USD	0.730		0.73068	
					20.06.	30.06.		USD	0.730		0.69908	
					20.09.	29.09.		USD	0.730		0.70631	
					20.12.	29.12.		USD	0.730		0.71136	
lastminute.com N.V., Amsterdam, Niederlande												
Inhaberaktien 17.9.2014/24.4.2017 Rückkauf eigener Aktien 3.5.2017/26.4.2019 Rückkauf eigener Aktien	EUR	0.010	23 806 732	15.400				EUR	0.000		0.000	
LEG Immobilien AG, Düsseldorf, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	20 516 489	110.400								
Ohne deutsche Kapitalertragsteuer, daher keinen Anspruch auf pauschale Steueranrechnung					18.05.	22.05.		EUR	2.760		3.019	(Z)
Lenovo Group Ltd., Hong Kong, Hongkong												
Namenaktien	HKD	0.000	1 058 002	0.540	10.07.	18.07.		HKD	0.205		0.02502	
					21.11.	30.11.		HKD	0.060		0.00754	
Lenzing AG, Lenzing, Österreich												
Inhaberaktien	EUR	0.000	428 654	123.500	27.04.	02.05.		EUR	3.000		3.250	
					27.04.	02.05.		EUR	1.200		1.300	(B)
Leoni AG, Nürnberg, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	1 465 666	72.990	12.05.	16.05.		EUR	0.500		0.54707	
Liechtensteinische Landesbank AG, Vaduz, Liechtenstein												
Inhaberaktien	CHF	5.00	3 019 524	-	16.05.	18.05.		CHF			1.700	
18.5.2017 Titelumtausch: 1 l'Akt. von CHF 5.00 nom. = 1 N'Akt. von CHF 5.00 nom. (VN 35514757)					18.05.	18.05.		CHF			0.000	
Namenaktien	CHF	5.00	35 514 757	49.650				CHF			0.000	
Lilly (Eli) and Company, Indianapolis, USA												
Stammaktien	USD	0.000	947 556	84.300	13.02.	10.03.		USD	0.520		0.52529	
					11.05.	09.06.		USD	0.520		0.50451	
					11.08.	08.09.	FR0013276235	USD	0.520		0.49283	
					14.11.	08.12.	FR0013295458	USD	0.520		0.5171	
Linde Aktiengesellschaft, München, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	340 045	210.360	11.05.	15.05.		EUR	3.700		4.048	
15.8.2017 Umtauschofferte: 1 Akt. Linde Aktiengesellschaft ohne Nennwert (anteiliger Betrag: EUR 2.56) = 1.54 Akt. Linde PLC von je EUR 0.001 nom.						15.08.		EUR	0.000		0.000	
Lloyds Banking Group plc, London, Grossbritannien												
Namenaktien	GBP	0.100	23 800	0.890	06.04.	16.05.		GBP	0.017		0.02168	
					06.04.	16.05.		GBP	0.005		0.00637	(B)
					10.08.	27.09.		GBP	0.010		0.01304	

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Lockheed Martin Corporation, Bethesda, USA											
Namenaktien	USD	1.00	351 011	311.000	27.02.	24.03.		USD	1.820		1.803
					30.05.	23.06.		USD	1.820		1.763
					30.08.	22.09.		USD	1.820		1.763
					30.11.	29.12.		USD	2.000		1.948
L'Oréal S.A., Paris, Frankreich											
au porteur	EUR	0.200	502 805	217.500	28.04.	03.05.		EUR	3.300		3.567
Low & Bonar PLC, London, Grossbritannien											
Namenaktien	GBP	0.050	394 290	0.720	16.03.	13.04.		GBP	0.020		0.02515
					24.08.	22.09.		GBP	0.0105		0.01376
LPKF Laser & Electronics AG, Garbsen, Deutschland											
Inhaberaktien	EUR	0.000	967 495	10.980				EUR	0.000		0.000
LumX Group Limited, St. Peter Port, Guernsey											
Namenaktien	CHF	1.00	3 381 261	0.200				CHF			0.000
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE, Paris, Frankreich											
	EUR	0.300	507 170	288.420	19.04.	21.04.		EUR	2.600		2.775
					05.12.	07.12.		EUR	1.600		1.873

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Magna International Inc., Aurora, Kanada											
Namenaktien	USD	0.000	693 266	56.470	08.03.	24.03.		USD	0.275		0.27258
					24.05.	09.06.		USD	0.275		0.26681
					30.08.	15.09.		USD	0.275		0.26408
					23.11.	08.12.		USD	0.275		0.27346
MAN SE, München, Deutschland											
	EUR	0.000	340 813	111.530	25.05.	26.05.		EUR	3.070		3.345
Manz AG, Reutlingen, Deutschland											
Inhaberaktien	EUR	0.000	2 699 736	36.310				EUR	0.000		0.000
Mastercard Incorporated, Purchase, USA											
Namenaktien	USD	0.0001	2 282 206	147.490	05.01.	09.02.		USD	0.220		0.22016
					05.04.	09.05.		USD	0.220		0.22118
					05.07.	09.08.		USD	0.220		0.21249
					05.10.	09.11.		USD	0.220		0.21961
Mattel, Inc., El Segundo, USA											
Namenaktien	USD	1.00	950 108	15.020	14.02.	03.03.		USD	0.380		0.38402
					17.05.	09.06.		USD	0.380		0.36868
					21.08.	15.09.		USD	0.150		0.14404
Mayr-Melhnhof Karton AG, Wien, Österreich											
Inhaberaktien	EUR	0.000	218 214	143.340	02.05.	09.05.		EUR	3.000		3.284
Mazda Motor Corporation, Hiroshima, Japan											
Namenaktien	JPY	0.000	762 466	13.000	29.03.	29.06.		JPY	20.000		0.16996
					27.09.	30.11.		JPY	15.000		0.13162
McDonald's Corporation, Oak Brook, USA											
Stammaktien	USD	0.010	950 605	169.370	27.02.	15.03.		USD	0.940		0.9476
					01.06.	19.06.		USD	0.940		0.91546
					30.08.	18.09.		USD	0.940		0.90265
					30.11.	15.12.		USD	1.010		1.001
McKesson Europe AG, Stuttgart, Deutschland											
Namenaktien 19.4.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben	EUR	0.000	2 596 238	30.880	11.08.	15.08.		EUR	0.830		0.94624
Mediaset SPA, Cologno Monzese, Italien											
Namenaktien	EUR	0.520	137 650	3.770				EUR	0.000		0.000
Medigene AG, Martinsried, Deutschland											
Namenaktien	EUR	0.000	22 188 143	14.890				EUR	0.000		0.000
Medtronic plc, Dublin, Irland											
Namenaktien	USD	0.0001	25 187 155	79.850	21.12.	13.01.		USD	0.430		0.43422
					22.03.	13.04.		USD	0.430		0.43206
					05.07.	26.07.		USD	0.460		0.44109
					28.09.	20.10.		USD	0.460		0.4524
Merck & Co., Inc., Kenilworth, USA											
Namenaktien	USD	0.500	10 683 053	54.830	13.12.	09.01.		USD	0.470		0.47779
					13.03.	07.04.		USD	0.470		0.47316
					13.06.	10.07.	FR0013261070	USD	0.470		0.45439
					14.09.	06.10.		USD	0.470		0.45968
Merck KGaA, Darmstadt, Deutschland											
Inhaberaktien	EUR	0.000	412 799	105.020	02.05.	04.05.		EUR	1.200		1.301
METRO AG, Düsseldorf, Deutschland											
Inhaberaktien	EUR	0.000	37 437 098	19.310				EUR	0.000		0.000
Michael Kors Holdings Limited, Britische Jungferninseln											
Namenaktien 11.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben	USD	0.000	14 480 037	61.340				USD	0.000		0.000

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Micron Technology, Inc., Boise, USA												
Namenaktien	USD	0.100	951 691	40.410				USD	0.000		0.000	
Microsoft Corporation, Redmond, USA												
	USD	0.00000625	951 692	83.890	14.02.	09.03.		USD	0.390		0.39565	
					16.05.	08.06.		USD	0.390		0.37719	
					15.08.	14.09.		USD	0.390		0.37709	
					15.11.	14.12.		USD	0.420		0.41584	
MLP SE, Wiesloch, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	340 699	6.580								
30.6.2017 Ohne deutsche Kapitalertragsteuer, daher keinen Anspruch auf pauschale Steueranrechnung					30.06.	04.07.		EUR	0.080		0.08763	(Z)
Mondelêz International, Inc., Northfield, USA												
Namenaktien	USD	0.000	19 549 948	41.700	28.12.	12.01.		USD	0.190		0.19153	
					29.03.	13.04.		USD	0.190		0.19091	
					28.06.	13.07.		USD	0.190		0.18386	
					28.09.	12.10.		USD	0.220		0.21476	
Monsanto Company, St. Louis, USA												
Namenaktien	USD	0.010	1 132 157	113.790	04.01.	27.01.		USD	0.540		0.53899	
					05.04.	28.04.		USD	0.540		0.53754	
					05.07.	28.07.		USD	0.540		0.5231	
					05.10.	27.10.		USD	0.540		0.53967	
Morgan Stanley, New York, USA												
Namenaktien	USD	0.010	653 571	51.130	27.01.	15.02.		USD	0.200		0.20168	
					27.04.	15.05.		USD	0.200		0.19932	
					27.07.	15.08.		USD	0.250		0.24321	
					30.10.	15.11.		USD	0.250		0.24742	
MorphoSys AG, Martinsried, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	944 497	91.040				EUR	0.000		0.000	
MTU Aero Engines AG, München, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	2 166 689	172.700	05.05.	09.05.		EUR	1.900		2.080	
Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG, München, Deutschland												
	EUR	0.000	341 960	212.140	27.04.	02.05.		EUR	8.600		9.318	
Mylan N.V., Niederlande												
Stammaktien	EUR	0.010	27 249 935	41.230				EUR	0.000		0.000	
11.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben												

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Nanogate SE, Quierschied, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	2 690 067	54.210								
30.6.2017 Ohne Deutsche Kapitalertragsteuer, daher keinen Anspruch auf pauschale Steueranrechnung					30.06.	04.07.		EUR	0.110		0.12049	(Z)
NATIXIS, Paris, Frankreich												
au porteur	EUR	1.60	489 526	7.710	26.05.	30.05.		EUR	0.350		0.38155	
Nemetschek SE, München, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	329 782	87.320	02.06.	07.06.		EUR	0.650		0.70554	
NetEase.com, Inc., Beijing, Kaimaninseln												
Namenaktien	USD	0.0001	1 100 118	336.260	01.03.	10.03.		USD	1.010		1.020	
ADR					24.05.	02.06.		USD	1.080		1.040	
					23.08.	01.09.		USD	0.830		0.79897	
					30.11.	08.12.		USD	0.720		0.71598	
Netflix, Inc., Los Gatos, USA												
Namenaktien	USD	0.001	1 413 346	190.000				USD	0.000		0.000	
Newcrest Mining Limited, Melbourne, Australien												
Namenaktien	AUD	0.000	650 853	17.390	22.03.	28.04.		AUD	0.09788		0.07286	(Z)
					20.09.	27.10.		AUD	0.09417		0.07202	(Z)
Newmont Mining Corporation, Greenwood Village, USA												
Stammaktien	USD	1.60	956 952	36.900	07.03.	23.03.		USD	0.050		0.04962	
					06.06.	22.06.		USD	0.050		0.04861	
					13.09.	28.09.		USD	0.075		0.07285	
					07.12.	28.12.		USD	0.075		0.07342	
Newron Pharmaceuticals S.p.A., Bresso, Italien												
Namenaktien	EUR	0.200	2 791 431	11.600				EUR	0.000		0.000	
NEXUS AG, Donaueschingen, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	1 099 292	30.410								
15.5.2017 Ohne deutsche Kapitalertragsteuer, daher keinen Anspruch auf pauschale Steueranrechnung					15.05.	17.05.		EUR	0.150		0.16368	(Z)
NIBE Industrier AB, Markaryd, Schweden												
Namenaktien	SEK	0.000	32 514 128	9.300	12.05.	18.05.		SEK	0.880		0.09813	
NIKE, Inc., Beaverton, USA												
Namenaktien	USD	0.000	957 150	61.470	01.12.	03.01.		USD	0.180		0.1852	
					02.03.	03.04.		USD	0.180		0.18054	
					01.06.	05.07.		USD	0.180		0.17387	
					31.08.	02.10.		USD	0.180		0.17522	
Nintendo Co., Ltd., Kyoto, Japan												
Namenaktien	JPY	0.000	762 921	358.060	29.03.	30.06.		JPY	430.00		3.664	
					27.09.	01.12.		JPY	110.00		0.95975	
Nokia Corporation, Espoo, Finnland												
	EUR	0.000	472 672	4.570	24.05.	09.06.		EUR	0.170		0.18446	
Nomura Holdings, Inc., Tokyo, Japan												
	JPY	0.000	763 146	5.690	29.03.	01.06.		JPY	11.000		0.09585	
					27.09.	01.12.		JPY	9.000		0.07852	
Nordea Bank AB, Stockholm, Schweden												
Inhaberaktien	EUR	0.000	831 257	11.770	17.03.	27.03.		SEK	6.159		0.69064	
Nordex SE, Rostock, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	2 083 267	10.380				EUR	0.000		0.000	
NORMA Group SE, Maintal, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	12 777 608	64.600	24.05.	29.05.		EUR	0.950		1.036	

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Norsk Hydro ASA, Oslo, Norwegen											
	NOK	1.09	599 373	7.490	04.05.	12.05.		NOK	1.250		0.14602
Novo Nordisk A/S, Bagsvaerd, Dänemark											
Namenaktien	DKK	0.200	23 159 222	52.500	24.03.	28.03.		DKK	4.600		0.66079
					18.08.	22.08.		DKK	3.000		0.45926
Novozymes A/S, Bagsvaerd, Dänemark											
Inhaberaktien	DKK	2.00	14 371 062	55.370	23.02.	27.02.		DKK	4.000		0.5743
Nu Skin Enterprises, Inc., Provo, USA											
Namenaktien	USD	0.000	551 585	66.480	23.02.	15.03.		USD	0.360		0.36291
					24.05.	14.06.		USD	0.360		0.3479
					23.08.	13.09.		USD	0.360		0.34676
					16.11.	06.12.		USD	0.360		0.35632
Nvidia Corporation, Santa Clara, USA											
Namenaktien	USD	0.001	994 529	188.560	22.02.	17.03.		USD	0.140		0.13971
					19.05.	14.06.		USD	0.140		0.13529
					22.08.	18.09.		USD	0.140		0.13443
					22.11.	15.12.		USD	0.150		0.14877

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Oesterreichische Post AG, Wien, Österreich											
Inhaberaktien	EUR	0.000	2 564 102	44.290	02.05.	04.05.		EUR	2.000		2.169
OMV AG, Wien, Österreich											
Inhaberaktien	EUR	0.000	430 021	63.150	31.05.	02.06.		EUR	1.200		1.304
Oracle Corporation, Redwood City, USA											
Namenaktien	USD	0.010	959 184	46.220	03.01.	26.01.		USD	0.150		0.15011
					10.04.	26.04.		USD	0.190		0.18898
					17.07.	02.08.		USD	0.190		0.18379
					10.10.	25.10.		USD	0.190		0.1881
Orange, Paris, Frankreich											
	EUR	4.00	720 128	16.960	12.06.	14.06.		EUR	0.400		0.43598
					05.12.	07.12.		EUR	0.250		0.2927
Organovo Holdings, Inc., San Diego, USA											
Namenaktien	USD	0.001	14 938 179	1.280				USD	0.000		0.000
OSRAM Licht AG, München, Deutschland											
Namenaktien	EUR	0.000	20 475 551	88.010		15.02.		EUR	1.000		1.066

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Pan American Silver Corp., Vancouver, Kanada												
Namenaktien	USD	0.000	696 996	15.320	23.02.	10.03.		USD	0.025		0.02525	
					18.05.	05.06.		USD	0.025		0.02411	
					17.08.	01.09.		USD	0.025		0.02406	
					17.11.	01.12.		USD	0.025		0.0246	
Panasonic Corporation, Kadoma, Japan												
Namenaktien	JPY	0.000	762 440	14.580	29.03.	08.06.		JPY	15.000		0.13171	
					27.09.	30.11.		JPY	10.000		0.08775	
Pandora A/S, Glostrup, Dänemark												
Stammaktien	DKK	1.00	11 784 376	106.000	16.03.	20.03.		DKK	9.000		1.297	
					16.05.	18.05.		DKK	9.000		1.316	(B)
					15.08.	17.08.		DKK	9.000		1.370	(B)
					14.11.	16.11.		DKK	9.000		1.414	(B)
PATRIZIA Immobilien AG, Augsburg, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	2 493 539	22.590				EUR	0.000		0.000	
19.7.2017 B.V.: 10 alte Akt. = 1 neue (gratis {anteiliger Betrag am Grundkapital = EUR 1.00})					19.07.	19.07.		EUR	0.100		0.10992	
10.8.2017 Aktienrückkaufofferte: 1 Akt. ohne Nennwert (anteiliger Betrag am Grundkapital: EUR 1.00) = Rückkaufspreis zwischen EUR 15.90 bis EUR 17.40 in bar pro zurückgekaufte Aktie						10.08.		EUR	0.000		0.000	
PayPal Holdings, Inc., San Jose, USA												
Namenaktien	USD	0.0001	28 467 085	72.390				USD	0.000		0.000	
PepsiCo Inc., New York, USA												
Stammaktien	USD	0.0167	961 618	116.850	30.11.	06.01.		USD	0.7525		0.76274	
					01.03.	31.03.		USD	0.7525		0.7532	
					31.05.	30.06.		USD	0.805		0.7709	
					30.08.	29.09.		USD	0.805		0.77888	
Pernod Ricard, Paris, Frankreich												
au porteur	EUR	1.55	508 063	153.680	05.07.	07.07.		EUR	0.940		1.032	
					20.11.	22.11.		EUR	1.080		1.251	
Petro Welt Technologies AG, Wien, Österreich												
Inhaberaktien	EUR	0.000	2 522 776	7.820				EUR	0.000		0.000	
Peugeot S.A., Paris, Frankreich												
au porteur	EUR	1.00	508 070	19.830	15.05.	17.05.		EUR	0.480		0.5238	
Pfeiffer Vacuum Technology AG, Asslar, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	502 775	179.900								
12.4.2017 Kaufofferte der Pangea GmbH zum Preis von EUR 110.00 pro Aktie					12.04.	12.04.		EUR	0.000		0.000	
					24.05.	29.05.		EUR	3.600		3.928	
Pfizer Inc., New York, USA												
Stammaktien	USD	0.050	962 004	35.290	01.02.	01.03.		USD	0.320		0.32284	
15.5.2017 Kaufofferte der TRC Capital Corporation zum Preis von USD 31.60 pro Aktie						15.05.		USD	0.000		0.000	
					10.05.	01.06.		USD	0.320		0.31022	
					02.08.	01.09.		USD	0.320		0.30803	
					09.11.	01.12.		USD	0.320		0.31493	
23.5.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben												
PG&E Corporation, San Francisco, USA												
Stammaktien	USD	5.00	567 472	43.700	28.12.	15.01.		USD	0.490		0.49538	
					29.03.	15.04.		USD	0.490		0.4908	
					28.06.	15.07.		USD	0.530		0.51038	
					28.09.	15.10.		USD	0.530		0.51683	

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Philip Morris International Inc., New York, USA												
Namenaktien	USD	0.000	3 754 629	102.000	20.12.	10.01.		USD	1.019		1.033	(Z)
					20.12.	10.01.		USD	0.0208		0.02108	
					21.03.	11.04.		USD	1.019		1.025	(Z)
					21.03.	11.04.		USD	0.0208		0.02092	
					21.06.	11.07.	FR0013263001	USD	1.019		0.98702	(Z)
					21.06.	11.07.		USD	0.0208		0.02014	
					26.09.	12.10.	FR0013284148	USD	1.048		1.023	(Z)
					26.09.	12.10.		USD	0.0214		0.02089	
Die US-Quellensteuer wurde jeweils nur auf 2% der Dividende erhoben. Der Anspruch auf die pauschale Steueranrechnung besteht nur auf diesem Teil.												
Plastic Omnium, Paris, Frankreich												
au porteur	EUR	0.060	508 106	44.160	03.05.	05.05.		EUR	0.490		0.53201	
Plug Power Inc., Latham, USA												
Namenaktien	USD	0.010	13 074 688	2.420				USD	0.000		0.000	
Porsche Automobil Holding SE, Stuttgart, Deutschland												
Vorzugsaktien	EUR	0.000	4 533 730	81.790	31.05.	02.06.		EUR	1.010		1.097	
PostNL N.V., Hoofddorp, Niederlande												
Inhaberaktien	EUR	0.080	12 871 311	4.770								
20.4.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					20.04.	11.05.		EUR	0.120		0.13132	(V)
9.8.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					09.08.	28.08.		EUR	0.060		0.0685	(V)
Prada S.p.A., Mailand, Italien												
Namenaktien	EUR	0.100	1 239 898	3.030	05.06.	20.06.		EUR	0.120		0.1303	
Premier Gold Mines Limited, Thunder Bay, Kanada												
Namenaktien	CAD	0.000	2 630 454	2.790				CAD	0.000		0.000	
14.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben												
Priceline Group Inc., (The), Norwalk, USA												
Namenaktien	USD	0.008	1 625 045	1740.000				USD	0.000		0.000	
Procter & Gamble Company (The), Cincinnati, USA												
Stammaktien	USD	0.000	963 896	89.920	18.01.	15.02.		USD	0.6695		0.67513	
					19.04.	15.05.		USD	0.6896		0.68727	
					19.07.	15.08.	FR0013270535	USD	0.6896		0.67088	
					19.10.	15.11.	FR0013291127	USD	0.6896		0.68249	
ProSiebenSat.1 Media SE, Unterföhring, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	21 967 295	33.610	15.05.	17.05.		EUR	1.900		2.073	
Prospect Capital Corporation, New York, USA												
Namenaktien	USD	0.001	1 916 685	6.740	28.12.	19.01.		USD	0.08333		0.08421	
					27.01.	16.02.		USD	0.08333		0.08321	
					24.02.	23.03.		USD	0.08333		0.0827	
					29.03.	20.04.		USD	0.08333		0.08291	
					26.04.	18.05.		USD	0.08333		0.08153	
					26.05.	22.06.		USD	0.08333		0.08101	
					28.06.	20.07.		USD	0.08333		0.07927	
					27.07.	24.08.		USD	0.08333		0.08037	
					29.08.	21.09.		USD	0.08333		0.08108	
					28.09.	19.10.		USD	0.060		0.05846	
					30.10.	22.11.		USD	0.060		0.05899	
					29.11.	21.12.		USD	0.060		0.05934	
Proximus SA, Bruxelles, Belgien												
au porteur	EUR	0.000	1 799 561	32.000	26.04.	28.04.		EUR	1.000		1.084	
					06.12.	08.12.		EUR	0.500		0.5843	

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
PSI Software AG, Berlin, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	10 263 289	21.290	17.05.	19.05.		EUR	0.220		0.240	
Publicis Groupe S.A., Paris, Frankreich												
au porteur 6.6.2017 au choix en espèces ou en actions	EUR	0.400	180 622	66.060	06.06.	04.07.		EUR	1.850		2.026	(Q)
PUMA SE, Herzogenaurach, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	481 322	424.760	13.04.	19.04.		EUR	0.750		0.80201	

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Qiagen N.V., Venlo, Niederlande												
Namenaktien	EUR	0.010	514 606	-								
25.1.2017 Zusammenlegung: 27 Akt. von je EUR 0.01 nom. = 26 Akt. von je EUR 0.01 nom. (VN 35465310)					25.01.	25.01.		EUR	0.000		0.000	
					25.01.	25.01.		USD	1.029		1.028	(Z)
Namenaktien	EUR	0.010	35 465 310	30.640				EUR	0.000		0.000	
QSC AG, Köln, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	1 062 813	1.760								
25.5.2017 Ohne Deutsche Kapitalertragsteuer, daher keinen Anspruch auf pauschale Steueranrechnung					25.05.	29.05.		EUR	0.030		0.03273	(Z)
Qualcomm Incorporated, San Diego, USA												
Namenaktien	USD	0.0001	964 930	62.380				USD				(I)
					27.02.	22.03.		USD	0.530		0.5246	
					26.05.	21.06.		USD	0.570		0.55562	
					28.08.	20.09.		USD	0.570		0.54823	
					28.11.	15.12.		USD	0.570		0.56534	

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Raiffeisen Bank International AG, Wien, Österreich												
Inhaberaktien	EUR	0.000	2 115 344	35.150				EUR	0.000		0.000	
Rambus Inc., Los Altos, USA												
Namenaktien	USD	0.001	644 116	13.890				USD	0.000		0.000	
Randstad Holding nv, Diemen, Niederlande												
Inhaberaktien	EUR	0.100	650 176	60.040	03.04.	07.04.		EUR	1.890		2.020	
Rational AG, Landsberg am Lech, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	635 626	623.500	04.05.	08.05.		EUR	2.000		2.180	(B)
					04.05.	08.05.		EUR	8.000		8.722	
Reckitt Benckiser Group plc, Slough, Grossbritannien												
Namenaktien	GBP	0.100	3 406 783	94.030	13.04.	25.05.		GBP	0.950		1.195	
					17.08.	28.09.		GBP	0.666		0.86985	
Regeneron Pharmaceuticals Inc., Tarrytown, USA												
Namenaktien	USD	0.001	965 755	369.200				USD	0.000		0.000	
Rémy Cointreau S.A., Paris, Frankreich												
Stammaktien	EUR	1.60	501 813	135.220								
1.8.2017 au choix en espèces ou en actions					01.08.	04.09.		EUR	1.650		1.879	(Q)
Renault SA, Boulogne-Billancourt, Frankreich												
au porteur	EUR	3.81	293 557	98.030	21.06.	23.06.		EUR	3.150		3.417	
Renesola Ltd, Road Town, Britische Jungferninseln												
Namenaktien	USD	0.000	35 553 743	2.590				USD	0.000		0.000	
ADR 11.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben												
Namenaktien	USD	0.000	3 736 994	-				USD	0.000		0.000	
ADR						10.02.		USD	0.000		0.000	
10.2.2017 Zusammenlegung: 5 ADR repr. je 2 Akt. ohne Nennwert = 1 ADR repr. 10 Akt. ohne Nennwert (VN 35553743)												
Rheinmetall AG, Düsseldorf, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	345 850	123.860	10.05.	12.05.		EUR	1.450		1.588	
RHI AG, Wien, Österreich												
Stammaktien	EUR	0.000	430 590	-				EUR				(I)
					10.05.	12.05.		EUR	0.750		0.82143	
Rhön-Klinikum AG, Bad Neustadt a.d. Saale, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	341 644	34.960	08.06.	12.06.		EUR	0.350		0.37997	
RIB Software SE, Stuttgart, Deutschland												
Namenaktien	EUR	1.00	10 590 731	29.040	31.05.	02.06.		EUR	0.160		0.17388	
Rio Tinto Limited, Melbourne, Australien												
Namenaktien	AUD	0.000	603 520	58.050	23.02.	06.04.		AUD	1.636		1.240	(Z)
					10.08.	21.09.		AUD	1.377		1.063	(Z)
27.9.2017 Aktienrückkaufofferte: 1 Akt. ohne Nennwert = AUD 9.44 in bar pro zurückgekaufte Aktie (Teilliquidation): Für Aktionäre, welche die Aktienrückkaufofferte angenommen haben, ist die Differenz zwischen dem Rückkaufspreis und dem Nennwert steuerbar												
Rio Tinto Plc, London, Grossbritannien												
	GBP	0.100	402 589	53.000	23.02.	06.04.		GBP	1.005		1.261	
					10.08.	21.09.		GBP	0.8313		1.095	

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Roche Holding AG, USA												
Namenaktien ADR	CHF	0.000	224 184	30.750	15.03.	11.05.		USD	1.027		1.034	
Rocket Internet SE, Berlin, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	25 428 305	24.690				EUR	0.000		0.000	
Rosenbauer International AG, Leonding, Österreich												
Inhaberaktien	EUR	0.000	279 389	61.530	23.05.	26.05.		EUR	1.200		1.307	
16.10.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben												
Royal Bank of Canada, Montreal, Kanada												
Stammaktien	CAD	0.000	699 232	79.640	24.01.	24.02.		CAD	0.830		0.63792	
					21.04.	24.05.		CAD	0.870		0.63215	
					24.07.	24.08.		CAD	0.870		0.67014	
					25.10.	24.11.		CAD	0.910		0.70155	
Royal Bank of Scotland Group plc, (The), Edinburgh, Grossbritannien												
Namenaktien	GBP	1.00	18 486 842	3.680				GBP	0.000		0.000	
Royal Dutch Shell Plc., Den Haag, Niederlande												
Namenaktien	EUR	0.070	1 987 674	32.650								
A					16.02.	27.03.		EUR	0.442		0.47309	(V)
16.2.2017 wahlweise in bar oder in Aktien												
18.5.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					18.05.	26.06.		EUR	0.4194		0.4559	(V)
10.8.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					10.08.	18.09.		EUR	0.3949		0.45332	(V)
16.11.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					16.11.	20.12.		EUR	0.3985		0.46626	(V)
Royal Dutch Shell Plc., Grossbritannien												
Namenaktien	EUR	0.070	1 987 676	33.110								
B					16.02.	27.03.		GBP	0.3864		0.47766	(Z)
16.2.2017 wahlweise in bar oder in Aktien												
18.5.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					18.05.	26.06.		GBP	0.3712		0.45887	(Z)
10.8.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					10.08.	18.09.		GBP	0.3628		0.47147	(Z)
16.11.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					16.11.	20.12.		GBP	0.3502		0.46229	(Z)
Royal Philips N.V., Eindhoven, Niederlande												
	EUR	0.200	1 106 818	37.150								
15.5.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					15.05.	14.06.		EUR	0.800		0.87196	(V)
RTL Group SA, Luxemburg												
au porteur	EUR	0.000	80 896	78.130	25.04.	27.04.	27	EUR	3.000		3.242	
					05.09.	07.09.		EUR	1.000		1.143	
RWE AG, Essen, Deutschland												
Stammaktien A	EUR	0.000	1 158 883	19.890				EUR	0.000		0.000	
Vorzugsaktien B	EUR	0.000	1 158 890	16.620	28.04.	03.05.		EUR	0.130		0.14055	

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
S & T AG, Linz, Österreich												
Inhaberaktien	EUR	0.000	10 395 864	21.040								
30.6.2017 Ohne österreichische Kapitalertragsteuer, daher keinen Anspruch auf pauschale Steueranrechnung					30.06.	04.07.		EUR	0.100		0.10954	(Z)
Sabina Gold & Silver Corp., Vancouver, Kanada												
Namenaktien	CAD	0.000	10 695 266	1.780				CAD	0.000		0.000	
16.10.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben												
Safestore Holdings PLC, Hertfordshire, Grossbritannien												
Namenaktien	GBP	0.010	2 983 188	6.580								
9.3.2017 mit britischer Quellensteuer von 20% (Ausnahmetatbestand UK: 5% rückforderbar; 15% pauschale Steueranrechnung bei Bruttodeklaration)					09.03.	07.04.		GBP	0.0805		0.10042	(Q)
13.7.2017 mit britischer Quellensteuer von 20% (Ausnahmetatbestand UK: 5% rückforderbar; 15% pauschale Steueranrechnung bei Bruttodeklaration)					13.07.	18.08.		GBP	0.021		0.02596	(Q)
					13.07.	18.08.		GBP	0.021		0.02596	(Z)
SAF-Holland S.A., Luxemburg												
Inhaberaktien	EUR	0.010	3 255 766	20.900		28.04.		EUR	0.440		0.47696	
SAFRAN SA, Paris, Frankreich												
au porteur	EUR	0.200	829 036	101.120	19.06.	21.06.		EUR	0.830		0.90154	
Saint-Gobain (Compagnie de), Courbevoie, Frankreich												
	EUR	4.00	490 580	54.120	12.06.	14.06.		EUR	1.260		1.373	
salesforce.com, inc., San Francisco, USA												
Namenaktien	USD	0.001	1 755 645	100.500				USD	0.000		0.000	
Salzgitter AG, Salzgitter, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	348 595	55.870	02.06.	07.06.	20	EUR	0.300		0.32563	
Sangamo Therapeutics, Inc., Richmond, USA												
Namenaktien	USD	0.010	1 066 659	15.980				USD	0.000		0.000	
11.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben												
Sanofi, Paris, Frankreich												
	EUR	2.00	699 381	84.250	16.05.	18.05.		EUR	2.960		3.222	
Santacruz Silver Mining Ltd., Vancouver, Kanada												
Namenaktien	CAD	0.000	18 418 138	0.080				CAD	0.000		0.000	
SAP SE, Walldorf, Deutschland												
	EUR	0.000	345 952	109.450	11.05.	15.05.		EUR	1.250		1.367	
Sartorius AG, Goettingen, Deutschland												
Vorzugsaktien	EUR	0.000	346 908	93.660	07.04.	11.04.		EUR	0.460		0.49192	
SBM Offshore N.V., Schiedam, Niederlande												
Inhaberaktien	EUR	0.250	2 509 888	17.160	19.04.	12.05.		USD	0.230		0.23062	
Schaeffler AG, Herzogenaurach, Deutschland												
Vorz-Inhaber-Akt stimmrechtlos	EUR	0.000	29 820 697	17.150	27.04.	02.05.		EUR	0.500		0.54175	
Schaltbau Holding AG, München, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	243 962	31.100				EUR	0.000		0.000	

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Schlumberger Limited, Curaçao											
	USD	0.010	555 100	64.000	05.12.	13.01.		USD	0.500		0.50491
					13.02.	18.04.		USD	0.500		0.49932
22.6.2017 Kaufofferte der TRC Capital Corporation zum Preis von USD 65.63 pro Aktie						22.06.		USD	0.000		0.000
					30.05.	14.07.	FR0013259926	USD	0.500		0.48265
					01.09.	13.10.		USD	0.500		0.48722
Schneider Electric SE, Rueil Malmaison, Frankreich											
au porteur	EUR	4.00	509 120	83.170	08.05.	10.05.		EUR	2.040		2.235
Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG, Ternitz, Österreich											
Stammaktien	EUR	0.000	656 876	99.310				EUR	0.000		0.000
Scor SE, Puteaux, Frankreich											
au porteur	EUR	7.87	2 844 943	39.240	02.05.	04.05.		EUR	1.650		1.789
Scout24 AG, München, Deutschland											
Namenaktien	EUR	0.000	29 613 036	39.300	09.06.	13.06.		EUR	0.300		0.32551
Serco Group plc, Hook, Grossbritannien											
Namenaktien	GBP	0.020	405 031	1.290				GBP	0.000		0.000
SGL Carbon SE, Wiesbaden, Deutschland											
Inhaberaktien	EUR	0.000	355 063	13.280				EUR	0.000		0.000
Sharp Corporation, Osaka, Japan											
Namenaktien	JPY	0.000	763 257	33.470				JPY	0.000		0.000
27.9.2017 Zusammenlegung: 10 Akt. ohne Nennwert = 1 Akt. ohne Nennwert					27.09.	01.10.		JPY	0.000		0.000
SHL TeleMedicine Ltd., Tel Aviv, Israel											
Namenaktien	ILS	0.010	1 128 957	6.310				ILS	0.000		0.000
SHW AG, Aalen-Wasseralfingen, Deutschland											
Inhaberaktien	EUR	0.000	13 217 205	38.950	10.05.	12.05.		EUR	1.000		1.095
11.7.2017 Kaufofferte der Pierer Industrie AG zum Preis von EUR 35.00 pro Aktie					11.07.	11.07.		EUR	0.000		0.000
Siemens Aktiengesellschaft, Berlin und München, Deutschland											
Namenaktien	EUR	0.000	827 766	135.300	02.02.	06.02.		EUR	3.600		3.838
Sierra Wireless, Inc., Richmond, Kanada											
Namenaktien	CAD	0.000	801 981	20.050				CAD	0.000		0.000
Siltronic AG, München, Deutschland											
Namenaktien	EUR	0.000	28 423 342	141.930				EUR	0.000		0.000
Silvercorp Metals Inc., Vancouver, Kanada											
Namenaktien	CAD	0.000	2 132 661	2.550	07.06.	30.06.		USD	0.010		0.00957
					27.11.	19.12.		USD	0.010		0.00987
11.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben											
Sixt Leasing SE, Pullach, Deutschland											
Inhaberaktien	EUR	0.000	28 042 432	22.230	30.06.	04.07.		EUR	0.480		0.52581
Sixt SE, Pullach, Deutschland											
Inhaberaktien	EUR	0.000	348 141	87.120	03.07.	05.07.		EUR	1.650		1.805
SMA Solar Technology AG, Niestetal, Deutschland											
Inhaberaktien	EUR	0.000	4 337 414	42.670	24.05.	26.05.		EUR	0.260		0.2833

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Smith & Nephew PLC, London, Grossbritannien											
Namenaktien	USD	0.200	1 103 058	16.970	30.03.	10.05.		GBP	0.1442		0.18828
					05.10.	01.11.		GBP	0.0934		0.12397
Snap Inc., Venice, USA											
Namenaktien	USD	0.00001	35 612 177	14.270				USD	0.000		0.000
Sociedad Comercial del Plata S.A., Buenos Aires, Argentinien											
Namenaktien	ARS	10.00	455 617	1.450				ARS	0.000		0.000
Société Générale, Paris, Frankreich											
au porteur	EUR	1.25	519 928	50.230	31.05.	02.06.		EUR	2.200		2.390
SoftBank Corp., Tokyo, Japan											
	JPY	0.000	245 595	77.760	29.03.	22.06.		JPY	22.000		0.19208
					27.09.	11.12.		JPY	22.000		0.19223
Software AG, Darmstadt, Deutschland											
Inhaberaktien	EUR	0.000	1 625 887	-	18.05.	22.05.		EUR	0.600		0.65649
2.10.2017 Titelumtausch: 1 l'Akt. ohne Nennwert {anteiliger Betrag am Grundkapital = EUR 1.00} = 1 N'Akt. ohne Nennwert {anteiliger Betrag am Grundkapital = EUR 1.00} (VN 38444555)					02.10.	04.10.		EUR	0.000		0.000
Namenaktien	EUR	0.000	38 444 555	54.590				EUR	0.000		0.000
SolarWorld AG, Bonn, Deutschland											
Inhaberaktien	EUR	0.000	23 511 936	0.630				EUR	0.000		0.000
8.6.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben											
Solocal Group, Sevres, Frankreich											
Stammaktien	EUR	6.00	29 725 518	0.960				EUR	0.000		0.000
14.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben											
Sony Corporation, Tokyo, Japan											
	JPY	0.000	763 300	44.110	29.03.	31.05.		JPY	10.000		0.08749
					27.09.	01.12.		JPY	12.500		0.10906
Splunk Inc., San Francisco, USA											
Namenaktien	USD	0.001	14 761 044	79.400				USD	0.000		0.000
SSR Mining Inc., Vancouver, Kanada											
Namenaktien	CAD	0.000	37 752 727	8.560				CAD	0.000		0.000
11.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben											
Namenaktien	CAD	0.000	700 117	-				CAD	0.000		0.000
3.8.2017 Titelumtausch: 1 Akt. SSR Mining Inc. (vormals Silver Standard Resources, Inc.) ohne Nennwert = 1 Akt. SSR Mining Inc. (neu) ohne Nennwert (VN 37752727)						03.08.		CAD	0.000		0.000
Stada Arzneimittel AG, Bad Vilbel, Deutschland											
Namenaktien	EUR	0.000	348 540	102.930							
19.7.2017 Kaufofferte der Nidda Healthcare Holding AG zum Preis von EUR 65.53 netto pro Aktie					19.07.	19.07.		EUR	0.000		0.000
					31.08.	04.09.		EUR	0.720		0.82004
Staples, Inc., Framingham, USA											
Namenaktien	USD	0.0006	972 817	-	19.12.	12.01.		USD	0.120		0.12096
					22.03.	13.04.		USD	0.120		0.12057
					21.06.	13.07.		USD	0.120		0.11612
13.9.2017 Fusion/Umtausch: 1 Akt. Staples, Inc. von USD 0.0006 = USD 10.25 in bar						13.09.		USD	0.000		0.000

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Starbucks Corporation, Seattle, USA												
Namenaktien	USD	0.001	973 403	55.960	07.02.	24.02.		USD	0.250		0.25166	
					09.05.	26.05.		USD	0.250		0.24357	
					08.08.	25.08.		USD	0.250		0.23959	
					15.11.	01.12.		USD	0.300		0.29524	
Statoil ASA, Stavanger, Norwegen												
Inhaberaktien	NOK	2.50	1 245 893	21.020								
22.2.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					22.02.	07.04.		NOK	1.838		0.21444	(Q)
12.5.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					12.05.	23.06.		NOK	1.878		0.21556	(Q)
9.8.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					09.08.	22.09.		NOK	1.749		0.21783	(Q)
1.11.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					01.11.	15.12.		NOK	1.795		0.21353	(Q)
Steinhoff International Holdings N.V., Amsterdam, Niederlande												
Namenaktien	EUR	0.500	29 210 745	0.360	16.03.	20.03.		EUR	0.030		0.03215	
STRATEC Biomedical Systems AG, Birkenfeld, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	29 256 738	76.180	15.06.	20.06.		EUR	0.770		0.8361	
Ströer SE & Co. KGaA, Köln, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	11 458 764	72.250	15.06.	20.06.		EUR	1.100		1.194	
Stryker Corporation, Kalamazoo, USA												
Namenaktien	USD	0.100	974 330	150.880	28.12.	31.01.		USD	0.425		0.41929	
					29.03.	28.04.		USD	0.425		0.42306	
					28.06.	31.07.		USD	0.425		0.41007	
					28.09.	31.10.		USD	0.425		0.42363	
Südzucker AG, Mannheim, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	349 450	21.150	21.07.	25.07.		EUR	0.450		0.49792	
SUESS MicroTec SE, Garching, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	13 673 056	19.540				EUR	0.000		0.000	
Suez SA, Paris, Frankreich												
au porteur	EUR	4.00	4 352 861	17.100	15.05.	17.05.		EUR	0.650		0.70931	
Suncor Energy Inc., Calgary, Kanada												
Namenaktien	CAD	0.000	10 339 747	35.890	01.03.	24.03.		CAD	0.320		0.23717	
					01.06.	26.06.		CAD	0.320		0.23453	
					31.08.	25.09.		CAD	0.320		0.25123	
					30.11.	22.12.		CAD	0.320		0.24829	
SunPower Corporation, San Jose, USA												
Namenaktien	USD	0.001	14 207 120	8.330				USD	0.000		0.000	
16.10.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben												
SURTECO SE, Buttenwiesen-Pfaffenhofen, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	872 152	31.470	30.06.	04.07.		EUR	0.800		0.87636	
Svenska Cellulosa Aktiebolaget SCA, Stockholm, Schweden												
Namenaktien	SEK	0.000	614 418	10.120	06.04.	12.04.		SEK	6.000		0.66912	
12.6.2017 Abspaltung: 1 Akt. = 1 Akt. Essity Aktiebolag ohne Nennwert (anteiliger Betrag: SEK 3.3464)					12.06.	15.06.		SEK	3.346		0.37071	
Swedbank AB, Sundbyberg, Schweden												
Namenaktien	SEK	20.00	212 308	23.690	31.03.	06.04.		SEK	13.200		1.472	
Symrise AG, Holzminden, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	2 810 536	82.650	18.05.	22.05.		EUR	0.850		0.93002	

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponibile CHF
TAG Immobilien AG, Hamburg, Deutschland											
Inhaberaktien	EUR	0.000	349 500	18.420	17.05.	19.05.		EUR	0.570		0.62184
Tahoe Resources Inc., Reno, Kanada											
Namenaktien	CAD	0.000	11 339 871	4.680	17.01.	26.01.		USD	0.020		0.02001
					14.02.	23.02.		USD	0.020		0.02011
					21.03.	30.03.		USD	0.020		0.01992
					18.04.	27.04.		USD	0.020		0.01989
					16.05.	25.05.		USD	0.020		0.01944
					20.06.	29.06.		USD	0.020		0.01913
					18.07.	27.07.		USD	0.020		0.01926
11.9.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben											
Takeda Pharmaceutical Company Limited, Osaka, Japan											
Namenaktien	JPY	0.000	763 546	55.360	29.03.	29.06.		JPY	90.000		0.76482
					27.09.	01.12.		JPY	90.000		0.78525
TAKKT AG, Stuttgart, Deutschland											
Inhaberaktien	EUR	0.000	800 573	21.750	11.05.	15.05.		EUR	0.550		0.60178
Talanx AG, Hannover, Deutschland											
Namenaktien	EUR	0.000	19 625 225	39.330	12.05.	16.05.		EUR	1.350		1.477
Tata Motors Limited, Mumbai, Indien											
Namenaktien	INR	2.00	1 960 506	32.220				INR	0.000		0.000
ADR											
Technip, Paris, Frankreich											
au porteur	EUR	0.7625	289 911	-				EUR	0.000		0.000
17.1.2017 Fusion/échange: 1 act. Technip de EUR 0.7625 nom. = 2 act. TechnipFMC plc USD 1.00 nom. chacune (NV 35308137)					17.01.	17.01.		EUR	0.000		0.000
TechnipFMC PLC, London, Grossbritannien											
Namenaktien	USD	1.00	35 308 137	30.240	20.11.	01.12.		USD	0.130		0.12794
Tele Columbus AG, Berlin, Deutschland											
Namenaktien	EUR	0.000	26 684 031	10.630				EUR	0.000		0.000
Telecom Italia S.p.A., Mailand, Italien											
Namenaktien	EUR	0.000	1 642 910	0.840				EUR	0.000		0.000
Telefonica Deutschland Holding AG, München, Deutschland											
Namenaktien	EUR	0.000	19 838 005	4.830							
Ohne deutsche Kapitalertragsteuer, daher keinen Anspruch auf pauschale Steueranrechnung					10.05.	12.05.		EUR	0.250		0.27381 (Z)
Telekom Austria AG, Wien, Österreich											
Inhaberaktien	EUR	0.000	1 151 075	9.040	16.06.	20.06.		EUR	0.200		0.21717
24.11.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben											
Telenor ASA, Fornebu, Norwegen											
Inhaberaktien	NOK	6.00	1 160 189	20.940	11.05.	24.05.		NOK	4.300		0.50092
					27.10.	07.11.		NOK	3.500		0.42707
Telia Company AB, Stockholm, Schweden											
Inhaberaktien	SEK	0.000	1 087 941	4.350	06.04.	12.04.		SEK	1.000		0.11152
					23.10.	27.10.		SEK	1.000		0.11927
Tesco PLC, Welwyn Garden City, Grossbritannien											
Namenaktien	GBP	0.050	408 910	2.740	12.10.	24.11.		GBP	0.010		0.01307

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Tesla Inc., Palo Alto, USA												
Namenaktien	USD	0.001	11 448 018	303.400				USD	0.000		0.000	
Teva Pharmaceutical Industries Ltd., Petah Tikva, Israel												
Namenaktien	ILS	0.100	758 744	18.460	28.02.	20.03.		USD	0.340		0.33886	
ADR					01.06.	22.06.		USD	0.340		0.33055	
					25.08.	14.09.		USD	0.085		0.08218	
					27.11.	12.12.		USD	0.085		0.08436	
Texas Instruments Incorporated, Dallas, USA												
Stammaktien	USD	1.00	976 910	102.330	27.01.	13.02.		USD	0.500		0.50254	
					27.04.	15.05.		USD	0.500		0.49831	
					27.07.	14.08.		USD	0.500		0.48506	
					30.10.	13.11.		USD	0.620		0.6172	
The Kraft Heinz Company, Pittsburgh, USA												
Namenaktien	USD	0.010	28 688 848	75.500	01.03.	17.03.		USD	0.600		0.59877	
					17.05.	16.06.		USD	0.600		0.58381	
					16.08.	15.09.		USD	0.625		0.60018	
					16.11.	15.12.		USD	0.625		0.6199	
Thermo Fisher Scientific Inc., Waltham, USA												
Namenaktien	USD	1.00	977 576	185.030	13.12.	16.01.		USD	0.150		0.15164	
					13.03.	17.04.		USD	0.150		0.15024	
					13.06.	17.07.		USD	0.150		0.14444	
					14.09.	16.10.		USD	0.150		0.14627	
20.11.2017 Kaufofferte der TRC Capital Corporation zum Preis von USD 181.75 pro Aktie						20.11.		USD	0.000		0.000	
Thomas Cook Group PLC, London, Grossbritannien												
Namenaktien	EUR	0.010	3 104 821	1.610	09.03.	05.04.		GBP	0.005		0.00626	
thyssenkrupp AG, Duisburg/ Essen, Deutschland												
	EUR	0.000	412 006	28.140	30.01.	01.02.		EUR	0.150		0.16014	
Time Warner Inc., New York, USA												
Namenaktien	USD	0.010	4 748 940	89.130	24.02.	15.03.		USD	0.4025		0.40575	
					26.05.	15.06.		USD	0.4025		0.39237	
					06.07.	01.08.		USD	0.4025		0.38867	
					06.10.	01.11.		USD	0.4025		0.40303	
T-Mobile US, Inc., Bellevue, USA												
Namenaktien	USD	0.00001	21 226 503	62.100				USD	0.000		0.000	
Tokyo Electric Power Co. Holdings, Inc, Tokyo, Japan												
Namenaktien	JPY	0.000	763 640	3.850				JPY	0.000		0.000	
TOM TAILOR Holding SE, Hamburg, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	11 134 677	12.600				EUR	0.000		0.000	
TomTom N.V., Amsterdam, Niederlande												
Inhaberaktien	EUR	0.200	2 162 172	9.630				EUR	0.000		0.000	
Toshiba Corporation, Tokyo, Japan												
	JPY	0.000	763 734	2.700				JPY	0.000		0.000	
Total S.A., Courbevoie, Frankreich												
au porteur	EUR	2.50	524 773	54.190								
21.12.2016 au choix en espèces ou en actions					21.12.	12.01.		EUR	0.610		0.6551	(Q)
20.3.2017 au choix en espèces ou en actions					20.03.	06.04.		EUR	0.610		0.65273	(Q)
5.6.2017 au choix en espèces ou en actions					05.06.	22.06.		EUR	0.620		0.67254	(Q)
25.9.2017 au choix en espèces ou en actions					25.09.	12.10.		EUR	0.620		0.71696	(Q)

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Toyota Motor Corporation, Toyota, Japan												
Namenaktien	JPY	0.000	763 969	62.280	29.03.	25.05.		JPY	110.00		0.95601	
					27.09.	27.11.		JPY	100.00		0.8834	
Tractor Supply Company, Brentwood, USA												
Namenaktien	USD	0.008	195 977	72.840	23.02.	14.03.		USD	0.240		0.24186	
					18.05.	06.06.		USD	0.270		0.26017	
					17.08.	06.09.		USD	0.270		0.25751	
					17.11.	05.12.		USD	0.270		0.26658	
TransDigm Group Incorporated, Cleveland, USA												
Namenaktien	USD	0.010	2 385 948	267.610	31.08.	12.09.		USD	22.000		21.112	(B)
30.11.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben												
Travelers Companies, Inc., New York, USA												
Namenaktien	USD	0.000	2 959 439	132.170	08.03.	31.03.		USD	0.670		0.67062	
					07.06.	30.06.		USD	0.720		0.6895	
					07.09.	29.09.		USD	0.720		0.69664	
					08.12.	29.12.		USD	0.720		0.70162	
TripAdvisor, Inc., Newton, USA												
Namenaktien	USD	0.001	14 491 714	33.370				USD	0.000		0.000	
Tui AG, Hannover, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	2 169 450	20.160	15.02.	17.02.		EUR	0.630		0.67035	
Twitter, Inc., San Francisco, USA												
Namenaktien	USD	0.000005	22 371 814	23.390				USD	0.000		0.000	

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Ubisoft Entertainment SA, Montreuil-sous-Bois, Frankreich												
au porteur	EUR	0.0775	491 199	76.190				EUR	0.000		0.000	
Under Armour, Inc., Baltimore, USA												
Namenaktien	USD	0.000333	2 263 631	14.060				USD	0.000		0.000	
Unibail-Rodamco SE, Paris, Frankreich												
au porteur	EUR	5.00	525 084	247.160	27.03.	29.03.		EUR	5.100		5.466	
					04.07.	06.07.		EUR	5.100		5.601	
UniCredit S.p.A., Milano, Italien												
Namenaktien	EUR	0.000	14 618 103	-				EUR	0.000		0.000	
23.1.2017 Zusammenlegung: 10 Akt. ohne Nennwert = 1 Akt. ohne Nennwert (VN 35395118)					23.01.	23.01.		EUR	0.000		0.000	
Namenaktien	EUR	0.000	35 395 118	18.320				EUR	0.000		0.000	
Unilever N.V., Rotterdam, Niederlande												
	EUR	0.160	2 560 588	55.290	09.02.	15.03.		EUR	0.3201		0.34303	
					04.05.	07.06.		EUR	0.3585		0.38913	
					03.08.	06.09.	NL0012440689	EUR	0.3585		0.40818	
					02.11.	13.12.	NL0012650592	EUR	0.3585		0.41691	
Union Pacific Corporation, Omaha, USA												
Namenaktien	USD	2.50	979 840	131.050	24.02.	31.03.		USD	0.605		0.60556	
					26.05.	30.06.		USD	0.605		0.57937	
					29.08.	29.09.		USD	0.605		0.58537	
					29.11.	28.12.		USD	0.665		0.65104	
24.11.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben												
Uniper SE, Düsseldorf, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	33 519 628	29.830				EUR				(I)
					09.06.	13.06.		EUR	0.550		0.59677	
Unisys Corporation, Blue Bell, USA												
Namenaktien	USD	0.010	10 641 130	7.500				USD	0.000		0.000	
United Internet AG, Montabaur, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	1 115 836	67.160	19.05.	23.05.		EUR	0.800		0.87284	
United Parcel Service, Inc., Atlanta, USA												
Namenaktien	USD	0.010	1 016 553	116.100	16.02.	08.03.		USD	0.830		0.8421	
					11.05.	31.05.		USD	0.830		0.80305	
					10.08.	30.08.		USD	0.830		0.79614	
					10.11.	29.11.		USD	0.830		0.81686	
United Technologies Corporation, Hartford, USA												
Stammaktien	USD	1.00	980 943	125.790	15.02.	10.03.		USD	0.660		0.66671	
					17.05.	10.06.		USD	0.660		0.63964	
					16.08.	10.09.		USD	0.700		0.66641	
					16.11.	10.12.		USD	0.700		0.69341	
UnitedHealth Group Incorporated, Minnetonka, USA												
Namenaktien	USD	0.010	1 078 451	214.830	08.03.	21.03.		USD	0.625		0.62092	
					15.06.	27.06.		USD	0.750		0.72368	
					07.09.	19.09.		USD	0.750		0.72207	
					30.11.	12.12.		USD	0.750		0.74443	

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Vale S.A., Rio de Janeiro, Brasilien												
Namenaktien ADR	BRL	0.000	10 230 933	11.850	24.04.	05.05.		USD	0.28313		0.27978	(B)
Valeant Pharmaceuticals International, Inc., Laval, Kanada												
Namenaktien	USD	0.000	11 728 900	20.450				USD	0.000		0.000	
Valeo SA, Paris, Frankreich												
Stammaktien	EUR	1.00	32 745 150	72.690	30.05.	01.06.		EUR	1.250		1.360	
Vallourec SA, Boulogne-Billancourt, Frankreich												
au porteur	EUR	2.00	525 585	5.920				EUR	0.000		0.000	
Valneva SE, Lyon, Frankreich												
Stammaktien	EUR	0.150	1 184 169	3.210				EUR	0.000		0.000	
Vapiano SE, Bonn, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	37 153 598	29.600				EUR	0.000		0.000	
Varta AG, Ellwangen, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	3 284 753	24.620				EUR	0.000		0.000	
Vectron Systems AG, Münster, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	2 978 635	23.900	26.06.	28.06.		EUR	1.000		1.091	
10.7.2017 Gratiskapitalerhöhung: 1 Akt. ohne Nennwert (anteiliger Betrag am Grundkapital = EUR 1.00) = 1 Akt. ohne Nennwert (anteiliger Betrag am Grundkapital = EUR 4.00)					10.07.	10.07.		EUR	3.000		3.303	
19.7.2017 Aufteilung: 1 Akt. ohne Nennwert (anteiliger Betrag: EUR 4.00) = 4 Akt. ohne Nennwert (anteiliger Betrag: EUR 1.00)					19.07.	21.07.		EUR	0.000		0.000	
Veolia Environnement S.A., Paris, Frankreich												
au porteur	EUR	5.00	1 098 758	25.050	24.04.	26.04.		EUR	0.800		0.86548	
verbio Vereinigte BioEnergie AG, Zörbig, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	2 731 349	9.530	30.01.	01.02.		EUR	0.150		0.16014	
Verbund AG, Wien, Österreich												
Inhaberaktien	EUR	0.000	430 175	23.560	12.04.	25.04.		EUR	0.290		0.31473	
Verizon Communications Inc., New York, USA												
Stammaktien	USD	0.100	1 095 642	52.530	06.01.	01.02.		USD	0.5775		0.57307	
					06.04.	01.05.		USD	0.5775		0.574	
					06.07.	01.08.		USD	0.5775		0.55767	
					06.10.	01.11.		USD	0.590		0.59078	
Vertex Pharmaceuticals Incorporated, Boston, USA												
Namenaktien	USD	0.010	983 327	147.380				USD	0.000		0.000	
Vestas Wind Systems A/S, Aarhus, Dänemark												
Namenaktien	DKK	1.00	1 081 674	66.680	07.04.	11.04.		DKK	9.710		1.396	
VF Corporation, Greensboro, USA												
Namenaktien	USD	0.000	983 365	72.110	08.03.	20.03.		USD	0.420		0.41859	
					07.06.	19.06.		USD	0.420		0.40903	
					07.09.	18.09.		USD	0.420		0.40331	
					07.12.	18.12.		USD	0.460		0.45334	
Villeroy & Boch AG, Mettlach, Deutschland												
Vorz.Akt. stimmrechtslos	EUR	0.000	352 629	22.760	27.03.	29.03.		EUR	0.530		0.56808	
Vinci, Rueil-Malmaison, Frankreich												
au porteur	EUR	2.50	508 670	99.950	25.04.	27.04.		EUR	1.470		1.588	
					07.11.	09.11.		EUR	0.690		0.80071	

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Visa Inc., San Francisco, USA												
Namenaktien	USD	0.0001	3 826 452	111.100	15.02.	07.03.		USD	0.165		0.16722	
					17.05.	06.06.		USD	0.165		0.15899	
					16.08.	05.09.		USD	0.165		0.15773	
					16.11.	05.12.		USD	0.195		0.19253	
Vivendi SA, Paris, Frankreich												
	EUR	5.50	1 165 915	26.290	02.05.	04.05.		EUR	0.400		0.43382	
Vodafone Group Plc, Newbury, Grossbritannien												
Namenaktien	USD	0.2095238	23 167 722	3.140	24.11.	03.02.		GBP	0.0405		0.0502	
						04.08.		GBP				(I)
Voestalpine AG, Linz, Österreich												
Inhaberaktien	EUR	0.000	414 921	58.480	13.07.	17.07.		EUR	1.100		1.215	
Volkswagen AG, Wolfsburg, Deutschland												
Prioritätsaktien	EUR	0.000	352 781	195.160	11.05.	15.05.		EUR	2.060		2.253	
Stammaktien	EUR	0.000	352 780	201.900	11.05.	15.05.		EUR	2.000		2.188	
Voltabox AG, Delbrueck, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	38 444 685	27.110				EUR	0.000		0.000	
Vonovia SE, Düsseldorf, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	21 644 750	48.230								
17.5.2017 wahlweise in bar oder in Aktien / ohne deutsche Kapitalertragsteuer, daher keinen Anspruch auf pauschale Steueranrechnung					17.05.	16.06.		EUR	1.120		1.220	(Z)
Vossloh AG, Werdohl, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	352 791	54.750				EUR	0.000		0.000	
voxeljet AG, Augsburg, Deutschland												
Namenaktien	EUR	1.00	22 415 604	4.680				EUR	0.000		0.000	
16.10.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben												
VP Bank AG, Vaduz, Liechtenstein												
Namenaktien	CHF	10.00	31 548 726	133.000	03.05.	05.05.		CHF			4.500	
7.6.2016/31.5.2017 Rückkauf eigener Aktien												
VTG AG, Hamburg, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	3 205 943	55.880	09.06.	13.06.		EUR	0.750		0.81378	

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Wacker Chemie AG, München, Deutschland											
Inhaberaktien	EUR	0.000	2 493 384	189.760	22.05.	24.05.		EUR	2.000		2.184
Wacker Neuson SE, München, Deutschland											
Namenaktien	EUR	0.000	2 611 520	34.690	31.05.	02.06.		EUR	0.500		0.54337
Walgreens Boots Alliance, Inc., Deerfield, USA											
Namenaktien	USD	0.010	26 526 295	70.760	13.02.	10.03.		USD	0.375		0.37881
					16.05.	12.06.		USD	0.375		0.36343
					16.08.	12.09.		USD	0.400		0.38387
16.11.2017 Kaufofferte der TRC Capital Corporation zum Preis von USD 67.88 pro Aktie						16.11.		USD	0.000		0.000
					10.11.	12.12.		USD	0.400		0.39703
Wal-Mart Stores Inc., Bentonville, USA											
	USD	0.100	984 101	97.210	07.12.	03.01.		USD	0.500		0.51446
					08.03.	03.04.		USD	0.510		0.51155
					10.05.	05.06.		USD	0.510		0.49193
					09.08.	05.09.		USD	0.510		0.48754
Walt Disney Company, (The), Burbank, USA											
Namenaktien	USD	0.010	984 192	105.440	08.12.	11.01.		USD	0.780		0.7984
					06.07.	27.07.		USD	0.780		0.75128
Weir Group PLC (The), Glasgow, Grossbritannien											
Namenaktien	GBP	0.125	94 339	27.980							
27.4.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					27.04.	05.06.		GBP	0.290		0.36175 (Z)
21.9.2017 wahlweise in bar oder in Aktien					21.09.	03.11.		GBP	0.150		0.19606 (Z)
Wells Fargo & Company, San Francisco, USA											
Namenaktien	USD	1.66	966 021	59.120	01.02.	01.03.		USD	0.380		0.38338
					03.05.	01.06.		USD	0.380		0.36838
					02.08.	01.09.		USD	0.390		0.37542
					02.11.	01.12.		USD	0.390		0.38382
Western Digital Corporation, Irvine, USA											
Namenaktien	USD	0.010	985 376	78.000	28.12.	17.01.		USD	0.500		0.50135
					29.03.	17.04.		USD	0.500		0.50082
					28.06.	17.07.		USD	0.500		0.48149
					28.09.	16.10.		USD	0.500		0.48758
Wheaton Precious Metals Corp., Vancouver, Kanada											
Namenaktien	CAD	0.000	36 429 694	20.500	23.05.	06.06.		USD	0.070		0.06745
12.6.2017 Kaufofferte der TRC Capital Corporation zum Preis von CAD 26.75 pro Aktie						12.06.		CAD	0.000		0.000
					23.08.	08.09.		USD	0.100		0.09477
					24.11.	07.12.		USD	0.090		0.08937
Namenaktien	CAD	0.000	2 026 227	-	03.04.	21.04.		USD	0.070		0.06991
16.5.2017 Titelumtausch: 1 Akt. Wheaton Precious Metals Corp. (vormals Silver Wheaton Corp.) ohne Nennwert = 1 Akt. Wheaton Precious Metals Corp. (neu) ohne Nennwert (VN 36429694)						16.05.		CAD	0.000		0.000
Whole Foods Market, Inc., Austin, USA											
Namenaktien	USD	0.000	986 306	-	11.01.	24.01.		USD	0.140		0.13986
					05.04.	18.04.		USD	0.140		0.13981
					28.06.	11.07.		USD	0.180		0.17431
29.8.2017 Fusion/Umtausch: 1 Akt. Whole Foods Market, Inc. ohne Nennwert = USD 42.00 in bar						29.08.		USD	0.000		0.000

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Wienerberger AG, Wien, Österreich												
Stammaktien	EUR	0.000	431 965	23.600	23.05.	26.05.		EUR	0.270		0.2942	
Wire Card AG, Berlin, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	1 514 179	108.920	21.06.	23.06.		EUR	0.160		0.1736	
Wm Morrison Supermarkets PLC, Bradford, Grossbritannien												
Namenaktien	GBP	0.100	396 765	2.860	25.05.	29.06.		GBP	0.0385		0.04788	
					28.09.	06.11.		GBP	0.0166		0.02179	
Woodside Petroleum Limited, Perth, Australien												
Namenaktien	AUD	0.000	642 429	24.850	02.03.	29.03.		AUD	0.64831		0.49511	(Z)
					24.08.	21.09.		AUD	0.61954		0.47843	(Z)
Wüstenrot & Württembergische AG, Stuttgart, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	896 326	27.330	02.06.	07.06.		EUR	0.600		0.65127	
WYNN RESORTS, LIMITED, Las Vegas, USA												
Namenaktien	USD	0.010	1 458 800	163.660	10.02.	28.02.		USD	0.500		0.50072	
					09.05.	23.05.		USD	0.500		0.48579	
					08.08.	22.08.		USD	0.500		0.48395	
					15.11.	28.11.		USD	0.500		0.4921	

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017 Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Xerox Corporation, Norwalk, USA												
Namenaktien	USD	1.00	36 933 852	28.430	28.06.	31.07.		USD	0.250		0.24122	
					28.09.	31.10.		USD	0.250		0.24919	
Stammaktien	USD	1.00	987 530	-								
3.1.2017 Abspaltung: 1 Akt. = 0.20 Akt. Conduent Incorporated von USD 0.01 nom. (VN 34558344)					03.01.	31.12.		USD	0.002		0.00205	
					13.12.	31.01.		USD	0.0775		0.07646	
					29.03.	28.04.		USD	0.0625		0.06221	
15.6.2017 Zusammenlegung: 4 Akt. von je USD 1.00 nom. = 1 Akt. von USD 1.00 nom. (VN 36933852)						15.06.		USD	0.000		0.000	
XING SE, Hamburg, Deutschland												
Namenaktien	EUR	0.000	2 794 147	311.850	17.05.	19.05.		EUR	1.370		1.494	
					17.05.	19.05.		EUR	1.600		1.745	(B)

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017						
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Yamana Gold Inc., Toronto, Kanada											
Namenaktien	CAD	0.000	1 657 932	3.040	28.12.	13.01.		CAD	0.00671		0.00516
					29.03.	13.04.		CAD	0.00666		0.00504
					28.06.	14.07.		CAD	0.00648		0.00494
					28.09.	13.10.		CAD	0.00624		0.00487
Yara International ASA, Oslo, Norwegen											
Inhaberaktien	NOK	1.70	1 735 299	44.870	12.05.	23.05.		NOK	10.000		1.164
Yelp Inc., San Francisco, USA											
Namenaktien	USD	0.000001	14 361 457	39.970				USD	0.000		0.000
Yingli Green Energy Holding Company Limited, Kaimaninseln											
Namenaktien ADR 16.10.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben	USD	0.010	30 857 397	1.640				USD	0.000		0.000
Yum! Brands, Inc., Louisville, USA											
Namenaktien	USD	0.000	1 413 362	79.520	11.01.	03.02.		USD	0.300		0.29737
					11.04.	05.05.		USD	0.300		0.29645
					12.07.	04.08.		USD	0.300		0.29188
					14.11.	08.12.		USD	0.300		0.29832
YY Incorporation, Grand Cayman, Kaimaninseln											
Namenaktien ADR	USD	0.00001	19 847 261	109.600				USD	0.000		0.000

Aktien (Ausland) / Actions (Etranger) / Azioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Dividenden / Dividendes / Dividendi 2017							
					Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	KEP CHF	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Zalando SE, Berlin, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	25 375 574	51.620				EUR	0.000		0.000	
ZEAL Network SE, London, Grossbritannien												
Namenaktien	EUR	0.000	23 689 692	23.900		29.12.		EUR	1.000		1.170	
Zimmer Biomet Holdings, Inc., Warsaw, USA												
	USD	0.010	1 262 932	118.780	28.12.	27.01.		USD	0.240		0.23955	
					29.03.	28.04.		USD	0.240		0.2389	
					21.06.	28.07.		USD	0.240		0.23249	
					21.09.	27.10.		USD	0.240		0.23985	
Zodiac Aerospace, Plaisir, Frankreich												
au porteur	EUR	0.000	525 785	29.170				EUR				(I)
25.1.2017 au choix en espèces ou en actions					25.01.	14.02.		EUR	0.160		0.17039	(Q)
					25.01.	14.02.		EUR	0.160		0.17039	
zooplus AG, München, Deutschland												
Inhaberaktien	EUR	0.000	4 211 633	175.000				EUR	0.000		0.000	
Zumtobel Group AG, Dornbirn, Österreich												
Inhaberaktien	EUR	0.000	2 542 508	12.040	31.07.	02.08.		EUR	0.230		0.26379	
24.11.2017 Kotierung an der SIX SX aufgehoben												
Zynga Inc., San Francisco, USA												
Namenaktien	USD	0.00000625	13 305 605	3.820				USD	0.000		0.000	

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF		IUP
1011778 BC Unlimited Liability Co/ New Red Finance Income, Kanada													
	USD	1'000.00	22.05.2015	15.01.2022	28 272 325	%	101.900	100.000	15.01. 15.07.	4.625	23.379 22.269		N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF		IUP
3i Group plc, London, Grossbritannien													
	EUR	1'000.00	17.03.2010	17.03.2017	11 127 009		-	99.667	17.03.	5.625	60.297		N
Emissionsdisagio von 0.333%									17.03.		3.569		
17.3.2017 Em.preis: 99.667%													
3M Company, St. Paul, USA													
	USD	1'000.00	26.06.2012	26.06.2017	18 896 542		-	99.539	26.06.	1.000	4.852		N
Emissionsdisagio von 0.461%									26.06.		4.473		
26.6.2017 Em.preis: 99.539%													
	EUR	1'000.00	08.11.2013	15.11.2021	22 795 549	%	106.450	99.338	15.11.	1.875	21.899		N
	USD	1'000.00	26.06.2012	26.06.2022	18 896 550	%	98.070	98.515	26.06.	2.000	9.704		N
									26.12.		9.895		

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	 %	 Brutto brut lordo CHF		IUP
4finance S.A., Luxemburg													
	EUR	1'000.00	23.05.2016	23.05.2021	32 635 858	%	110.500	100.000	23.05. 23.11.	11.250	60.867 65.942		N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
A. P. Møller-Mærsk A/S, Copenhagen, Dänemark												
	EUR	1'000.00	24.11.2010	24.11.2017	12 055 304		-	99.646	24.11. 24.11.	4.375	51.124 4.136	N
Emissionsdisagio von 0.354% 24.11.2017 Em.preis: 99.646%												
	USD	1'000.00	22.09.2014	22.09.2019	25 472 623	%	99.920	99.795	22.03. 22.09.	2.550	12.620 12.353	N
	EUR	1'000.00	24.11.2015	24.11.2022	30 486 970	%	103.010	99.225	24.11.	1.500	17.528	N
Aareal Bank Capital Funding Trust, New York, USA												
	EUR	25.00	20.11.2001	09.05.2017	1 328 011		-	100.000	31.03.	7.125	0.47019	N
31.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
AB Svensk Exportkredit, Stockholm, Schweden												
	TRY	1'000.00	23.01.2013	23.01.2017	20 434 091		-	101.088	23.01.	5.500	14.656	N
	CHF	5'000.00	09.02.2007	09.02.2017	2 857 703		-	101.105	09.02.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	08.03.2010	08.03.2017	10 936 182		-	100.316	08.03.	1.875	93.750	N
	CHF	5'000.00	27.02.2009	27.02.2018	1 799 247	%	100.570	100.633	27.02.	3.000	150.00	N
	GBP	1'000.00	11.02.2014	21.12.2018	23 645 899	%	101.300	99.448	21.12.	1.875	24.767	N
	CHF	5'000.00	18.07.2013	17.07.2023	21 632 071	%	107.850	100.029	17.07.	1.250	62.500	N
	ZAR	5'000.00	25.06.1997	25.06.2027	647 322	%	41.900	2.780		0.000	0.000	Y
ABB Finance (USA) Inc., Stamford, USA												
Tranche 1	USD	1'000.00	08.05.2012	08.05.2017	18 540 980		-	99.300	08.05. 08.05.	1.625	8.103 6.981	N
Emissionsdisagio von 0.7% 8.5.2017 Em.preis: 99.3%												
Tranche 2	USD	1'000.00	08.05.2012	08.05.2022	18 540 982	%	100.400	97.833	08.05. 08.11.	2.875	14.337 14.375	N
ABB Treasury Center (USA) Inc, Stamford, USA												
	USD	1'000.00	17.06.2011	15.06.2021	13 198 679	%	104.900	98.406	15.06. 15.12.	4.000	19.496 19.836	N
Abbey National plc, London, Grossbritannien												
	GBP	1'000.00	14.04.2011	14.04.2021	12 853 187	%	113.210	99.725	14.04.	5.125	64.650	N
AbbVie Inc., North Chicago, USA												
	USD	1'000.00	06.05.2013	06.11.2042	21 858 614	%	106.290	98.964	06.05. 06.11.	4.400	21.942 22.012	N
Abertis Infraestructuras, S.A., Barcelona, Spanien												
	EUR	100'000.00	30.03.2005	30.03.2020	2 100 029	%	109.250	99.085	30.03.	4.375	4'678.40	N
ABN AMRO Bank NV, Amsterdam, Niederlande												
	CHF	5'000.00	16.02.2012	16.02.2017	14 861 142		-	100.709	16.02.	2.500	125.00	N
	CHF	5'000.00	19.04.2012	19.04.2017	18 259 510		-	100.550	19.04.	1.000	50.000	N
	NOK	10'000.00	06.06.2014	06.06.2017	24 560 905		-	100.906	06.06.	2.250	25.578	N
	EUR	1'000.00	06.10.2010	06.10.2017	11 817 514		-	99.921	06.10. 06.10.	3.625	41.596 0.90652	N
Emissionsdisagio von 0.079% 6.10.2017 Em.preis: 99.921%												
	NOK	10'000.00	15.01.2013	15.01.2018	20 422 499	%	100.160	101.233	15.01.	3.125	37.122	N
	CAD	2'000.00	25.01.2013	25.01.2018	20 465 471	%	100.090	101.575	25.01.	2.750	42.096	N
	NZD	2'000.00	05.02.2013	05.02.2018	20 557 981	%	100.160	101.364	05.02.	4.375	63.516	N
	EUR	50'000.00	01.03.2007	01.03.2018	2 958 273		-	99.513	01.03. 01.03.	4.250	2'263.12 259.32	N
Emissionsdisagio von 0.487% 1.3.2017 Em.preis: 99.513%												
	AUD	2'000.00	10.04.2013	10.04.2018	21 086 585	%	100.350	101.308	10.04.	4.625	69.924	N
	EUR	1'000.00	30.06.2011	29.06.2018	13 153 772	%	102.140	100.250	30.06.	4.250	46.420	N
	CHF	5'000.00	10.02.2011	10.07.2018	12 355 542	%	101.580	100.262	10.07.	2.250	112.50	N
	NZD	2'000.00	12.09.2013	12.09.2018	22 248 528	%	102.130	101.321	12.09.	5.750	80.548	N
	CAD	2'000.00	24.09.2013	24.09.2018	22 340 337	%	101.100	101.084	24.09.	3.500	54.957	N
	CHF	5'000.00	25.10.2013	25.10.2018	22 532 328	%	101.400	100.415	25.10.	1.125	56.250	N
	EUR	1'000.00	11.01.2012	11.01.2019	14 684 088	%	104.990	99.732	11.01.	4.750	51.038	N
	EUR	1'000.00	12.01.2011	12.01.2019	12 275 606	%	99.740	99.695	12.01.	3.500	37.691	N
	CHF	5'000.00	31.01.2014	31.01.2019	23 266 354	%	101.750	100.415	31.01.	1.125	56.250	N
	AUD	1'000.00	05.02.2014	05.02.2019	23 576 957	%	102.360	99.015	05.02. 05.08.	4.750	18.158 18.110	N
	NOK	10'000.00	14.03.2014	14.03.2019	23 833 986	%	102.420	101.235	14.03.	3.125	36.629	N
	AUD	2'000.00	21.03.2013	21.03.2019	20 905 829	%	103.270	101.408	21.03.	5.000	76.666	N
	AUD	2'000.00	16.04.2014	16.04.2019	24 150 051	%	102.690	100.782	16.04.	4.625	70.473	N
	NZD	2'000.00	17.12.2013	17.06.2019	23 067 894	%	104.540	101.072	17.06.	6.000	84.658	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	AUD	2'000.00	23.07.2013	23.07.2019	21 868 913	%	104.210	101.098	23.07.	5.250	78.804	N
	CHF	5'000.00	27.09.2013	27.12.2019	21 507 633	%	103.800	100.570	27.12.	1.500	75.000	N
	NZD	2'000.00	21.01.2015	21.01.2020	26 579 518	%	103.150	101.530	21.01.	4.750	68.717	N
	NZD	2'000.00	17.03.2014	17.03.2020	23 876 086	%	105.900	101.180	17.03.	5.750	80.432	N
	AUD	10'000.00	09.04.2015	09.04.2020	27 777 568	%	100.880	99.520	09.04. 09.10.	3.250	122.50 123.91	N
	CHF	5'000.00	24.04.2014	24.04.2020	24 090 709	%	103.100	100.630	24.04.	1.125	56.250	N
	EUR	1'000.00	09.06.2015	09.06.2020	28 453 497	%	101.870	99.430	09.06.	0.750	8.138	N
	EUR	1'000.00	31.07.2012	31.07.2020	19 128 127	%	103.580	99.786	31.07.	1.875	21.330	N
	AUD	2'000.00	10.12.2013	10.12.2020	22 987 568	%	107.620	99.785	10.12.	5.625	84.053	N
	AUD	2'000.00	17.03.2014	17.03.2021	23 823 958	%	106.910	100.975	17.03.	5.250	80.574	N
	EUR	1'000.00	27.04.2011	27.04.2021	12 919 265	%	118.570	99.603	27.04.	6.375	68.904	N
	CHF	100'000.00	27.04.2011	27.04.2021	12 751 311	%	110.350	100.083	27.04.	3.125	3'125.00	N
	CHF	5'000.00	27.04.2011	27.04.2021	12 786 018	%	110.650	100.968	27.04.	2.625	131.25	N
	EUR	1'000.00	22.06.2010	22.06.2021	11 439 552	%	109.590	99.080	22.06.	3.625	39.322	N
	CHF	5'000.00	28.06.2011	28.06.2021	13 122 073	%	110.900	100.252	28.06.	3.125	156.25	N
	EUR	1'000.00	09.02.2012	09.02.2022	14 805 253	%	118.810	100.500	09.02.	5.000	53.362	N
	EUR	1'000.00	28.03.2012	28.03.2022	18 252 577	%	115.960	99.570	28.03.	4.125	44.092	N
	EUR	1'000.00	06.04.2011	06.04.2022	12 791 585	%	113.820	99.393	06.04.	4.250	45.477	N
	EUR	1'000.00	06.07.2012	06.07.2022	18 979 198	%	127.250	99.589	06.07.	7.125	78.250	N
	CHF	5'000.00	29.07.2015	29.07.2022	28 550 940	%	102.000	100.395	29.07.	0.500	25.000	N
	EUR	1'000.00	18.01.2012	18.01.2023	14 741 848	%	114.140	99.892	18.01.	3.500	37.589	N
	CHF	5'000.00	18.07.2012	18.07.2023	18 872 685	%	109.350	100.268	18.07.	1.500	75.000	N
	EUR	1'000.00	21.09.2010	21.09.2023	11 763 141	%	115.980	99.547	21.09.	3.500	40.603	N
	EUR	1'000.00	29.05.2013	29.11.2023	21 486 978	%	111.800	99.415	29.11.	2.500	29.157	N
	CHF	5'000.00	18.03.2016	18.12.2024	31 559 386	%	100.150	100.151	18.12.	0.300	15.000	N
	EUR	1'000.00	16.04.2015	16.04.2025	27 850 838	%	101.880	99.067	16.04.	1.000	10.681	N
	CHF	100'000.00	15.08.2006	15.08.2031	2 630 230	%	141.050	102.440	15.08.	3.375	3'375.00	N
Accor S.A., Paris, Frankreich												
	CHF	5'000.00	27.06.2014	27.06.2022	24 586 584	%	105.900	100.637	27.06.	1.750	87.500	N
Achmea Bank N.V., Tilburg, Niederlande												
	CHF	100'000.00	22.08.2007	22.08.2017	3 273 616		-	100.071	22.08.	3.500	3'500.00	N
	CHF	5'000.00	27.04.2017	27.10.2023	36 364 550	%	101.300	100.288	27.10.	0.500	12.500	N
	CHF	5'000.00	03.10.2017	03.10.2025	38 245 164	%	100.550	100.648		0.500	0.000	N
Achmea BV, Zeist, Niederlande												
	EUR	1'000.00	01.11.2006		2 741 134	%	105.680	100.000	01.11.	6.000	69.792	N
ADCB Finance Cayman Ltd, Cayman Island, Kaimaninseln	CHF	5'000.00	19.06.2013	19.06.2019	21 293 723	%	102.400	100.180	19.06.	1.500	75.000	N
	AUD	10'000.00	28.05.2014	28.05.2019	24 513 872	%	102.180	98.993	28.05. 28.11.	4.750	171.14 179.07	N
	USD	1'000.00	15.09.2014	16.09.2019	25 427 887	%	99.760	99.940	16.03. 16.09.	2.750	13.686 13.203	N
	CHF	5'000.00	13.06.2013	13.06.2023	21 433 373	%	100.950	100.237	13.06.	1.875	93.750	N
Adecco International Financial Services B.V., Zaltbommel, Niederlande												
	EUR	1'000.00	14.04.2011	13.04.2018	12 850 105	%	101.220	99.453	13.04.	VAR.	50.713	N
	USD	1'000.00	21.11.2017	21.11.2021	39 173 920	%	98.670	99.334		2.625	0.000	N
	EUR	1'000.00	22.05.2015	22.11.2022	28 301 838	%	104.900	99.939	22.11.	1.500	17.385	N
Adidas AG, Herzogenaurach, Deutschland												
	EUR	1'000.00	08.10.2014	08.10.2021	25 618 831	%	103.080	99.145	08.10.	1.250	14.372	N
AEGON N.V., Den Haag, Niederlande	EUR	1'000.00	08.10.2014	08.10.2026	25 617 520	%	106.940	99.357	08.10.	2.250	25.870	N
	USD	100.00	15.07.2004		1 893 808	%	86.800	100.000	17.01. 18.04. 17.07. 15.10.	VAR.	0.41104 0.56922 0.55853 0.58509	N
Emissionsdisagio von 0.288% 18.7.2017 Em.preis: 99.712%	EUR	1'000.00	18.07.2012	18.07.2017	19 034 218		-	99.712	18.07. 18.07.	3.000	33.111 3.178	N
Aequitas Income Opportunities (Luxembourg) S.A., Luxemburg												
	USD	200'000.00	31.07.2015	31.07.2018	29 217 890		n.v.	100.000	01.01. 01.04. 01.07. 01.10.	8.000	4'115.75 4'012.20 3'852.39 3'893.82	N
Aeroports de Paris ADP, Paris, Frankreich												
	CHF	5'000.00	27.01.2010	27.01.2017	10 878 505		-	100.744	27.01.	2.500	125.00	N
	EUR	100'000.00	11.06.2012	11.06.2019	18 748 576	%	103.170	99.669	11.06.	2.375	2'578.41	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Africa Finance Corporation, Ikoyi, Nigeria												
	CHF	5'000.00	27.07.2016	27.12.2019	33 004 985	%	100.900	100.000	27.12.	0.850	42.500	N
African Bank Limited, Midrand, Südafrika												
Tranche 1 Reg S	CHF	4'000.00	04.04.2016	18.03.2019	31 014 054	%	99.500	100.000	18.03.	4.750	181.55	N
Tranche 1 Reg S	CHF	4'000.00	04.04.2016	22.04.2022	31 014 060	%	98.750	100.000	22.04.	5.000	200.00	N
African Development Bank, Abidjan, Elfenbeinküste												
	AUD	1'000.00	31.01.2013	31.01.2018	20 549 955	%	100.140	99.852	31.01. 31.07.	3.500	13.214 13.369	N
	CHF	5'000.00	25.05.2009	25.03.2019	10 152 667	%	104.220	100.858	25.03.	2.625	131.25	N
	USD	1'000.00	06.04.1993	06.04.2023	61 514	%	122.080	98.560	06.04.	7.375	74.047	N
Agence Française de Développement, Paris, Frankreich												
	CHF	5'000.00	18.02.2010	18.02.2025	10 915 582	%	118.400	100.644	18.02.	2.625	131.25	N
Agrokor DD, Zagreb, Kroatien												
	EUR	1'000.00	25.04.2012	01.05.2019	18 463 685	%	25.800	100.000	02.05. 01.11.	9.875	53.497 57.433	N
	EUR	1'000.00	10.10.2012	01.02.2020	19 709 080	%	25.000	100.000	01.02. 01.08.	9.125	48.711 52.033	N
Air Berlin PLC, Rickmansworth, Grossbritannien												
	EUR	1'000.00	19.04.2011	19.04.2018	12 868 139	%	1.110	100.000	19.01. 19.04. 19.07. 19.10.	8.250	22.301 21.753 22.609 24.017	N
	CHF	5'000.00	09.05.2014	09.05.2019	24 346 372	%	1.850	100.000	09.05. 09.11.	5.625	139.46 141.78	N
	EUR	1'000.00	09.05.2014	09.05.2019	24 352 565	%	1.250	100.000	09.05. 09.11.	6.750	36.650 39.487	N
Air (L') Liquide S.A., Paris, Frankreich												
	EUR	50'000.00	06.10.2010	12.10.2018	11 854 088	%	102.210	100.000	12.10.	2.908	1'681.40	N
	EUR	100'000.00	06.03.2013	06.09.2023	20 830 483	%	110.270	99.869	06.09.	2.375	2'704.17	N
Air Liquide Finance, Paris, Frankreich												
Emissionsdisagio von 0.16% 18.7.2017 Em.preis: 99.84%	EUR	50'000.00	18.07.2007	18.07.2017	3 261 714		-	99.840	18.07. 18.07.	5.250	2'897.21 88.296	N
	EUR	50'000.00	09.06.2010	09.06.2020	11 397 227	%	109.530	100.000	09.06.	3.889	2'109.97	N
	EUR	100'000.00	15.10.2012	15.10.2021	19 780 118	%	107.410	99.329	15.10.	2.125	2'444.70	N
Airbus Finance B.V., Niederlande												
	EUR	1'000.00	25.09.2003	25.09.2018	1 681 607	%	104.100	99.226	25.09.	5.500	63.258	N
	USD	1'000.00	17.04.2013	17.04.2023	21 136 108	%	100.470	99.748	17.04. 17.10.	2.700	13.522 13.230	N
Akademiska Hus AB, Goteborg, Schweden												
	CHF	5'000.00	04.03.2010	04.07.2018	10 988 912	%	101.460	100.032	04.07.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	22.02.2011	22.02.2021	12 391 842	%	108.250	100.352	22.02.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	17.11.2015	17.11.2025	30 154 934	%	101.300	100.842	17.11.	0.250	12.500	N
	CHF	5'000.00	08.09.2017	08.10.2029	37 394 508	%	100.100	100.393		0.300	0.000	N
Akbank T.A.S., Istanbul, Türkei												
	USD	1'000.00	09.03.2011	09.03.2018	12 634 090	%	99.850	99.656	09.03. 09.09.	6.500	32.971 30.940	N
	USD	1'000.00	09.03.2011	09.03.2018	12 634 066	%	99.930	99.656	09.03. 09.09.	6.500	32.971 30.940	N
Aktia Pankki Oyj, Helsinki, Finnland												
	EUR	1'000.00	25.06.2013	25.06.2018	21 679 805	%	100.710	99.797	25.06.	1.125	12.229	N
Akzo Nobel N.V., Amsterdam, Niederlande												
	EUR	1'000.00	15.12.2011	17.12.2018	14 515 501	%	103.860	99.187	17.12.	4.000	46.566	N
Akzo Nobel Sweden Finance AB, Bohus, Schweden												
	EUR	1'000.00	27.07.2012	27.07.2022	19 108 256	%	109.750	98.911	27.07.	2.625	29.495	N
Albea Beauty Holding SA, Luxemburg												
20.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	31.10.2012	01.11.2019	19 866 748		-	100.000	20.04.	8.750	44.005	N
Alfa Holding Issuance PLC, Dublin, Irland												
	CHF	5'000.00	06.12.2013	16.01.2018	22 517 331	%	99.970	100.000	16.01.	4.000	200.00	N
	CHF	5'000.00	09.11.2017	09.11.2022	38 551 808	%	100.050	100.000		2.875	0.000	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Allianz Finance II BV, Amsterdam, Niederlande												
	EUR	1'000.00	03.03.2006		2 468 959	%	107.000	100.000	03.03.	5.375	57.375	N
Emissionsdisagio von 1.077% 17.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	17.02.2005	28.02.2017	2 057 864		-	98.923	17.02. 17.02.	4.375	46.679 11.459	N
	EUR	50'000.00	22.07.2009	22.07.2019	10 377 332	%	107.700	98.805	22.07.	4.750	2'616.06	N
Allianz SE, München, Deutschland	EUR	100'000.00	21.04.2016	21.04.2031	32 275 938	%	99.730	99.731	21.04.	1.375	1'467.74	N
	CHF	5'000.00	04.02.2014		23 483 337	%	104.300	101.000	04.07.	3.250	163.00	N
ALNO AG, Pfullendorf, Deutschland												
	EUR	1'000.00	14.05.2013	14.05.2018	21 255 932	%	2.950	100.000	14.05.	8.500	93.002	N
Alstom, Paris, Frankreich												
Emissionsdisagio von 0.304% 1.2.2017 Em.preis: 99.696%	EUR	50'000.00	01.02.2010	01.02.2017	10 962 433		-	99.696	01.02. 01.02.	4.125	2'208.06 162.28	N
Emissionsdisagio von 0.56% 11.10.2017 Em.preis: 99.44%	EUR	100'000.00	11.10.2012	11.10.2017	19 754 412		-	99.440	11.10. 11.10.	2.250	2'591.66 645.03	N
	EUR	100'000.00	05.10.2010	05.10.2018	11 820 649	%	102.800	99.734	05.10.	3.625	4'152.61	N
Altria Group, Inc., Richmond, USA	EUR	50'000.00	18.03.2010	18.03.2020	11 121 739	%	109.890	99.873	20.03.	4.500	2'424.65	N
	USD	1'000.00	05.05.2011	05.05.2021	12 963 095	%	106.550	99.575	05.05. 05.11.	4.750	23.468 23.763	N
Amazon.Com, Inc., Seattle, USA	USD	1'000.00	09.08.2012	09.08.2022	19 223 896	%	100.450	99.888	09.02. 09.08.	2.850	14.260 13.763	N
Emissionsdisagio von 0.487% 29.11.2017 Em.preis: 99.513%	USD	1'000.00	29.11.2012	29.11.2017	20 120 723		-	99.513	29.05. 29.11. 29.11.	1.200	5.857 5.905 4.792	N
Amcor Limited, Hawthorn, Australien	USD	1'000.00	29.11.2012	29.11.2022	20 120 731	%	99.800	99.116	29.05. 29.11.	2.500	12.203 12.302	N
	CHF	5'000.00	04.04.2012	04.04.2018	18 000 617	%	100.610	100.022	04.04.	2.125	106.25	N
América Móvil, S.A.B. de C.V., México, Mexiko	EUR	1'000.00	22.03.2013	22.03.2023	20 974 586	%	109.250	99.629	22.03.	2.750	29.401	N
	CHF	5'000.00	27.09.2011	27.12.2017	13 750 117		-	100.226	27.12.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	12.09.2012	12.09.2018	19 289 275	%	101.130	100.392	12.09.	1.125	56.250	N
	USD	1'000.00	16.04.2010	16.10.2019	11 585 769	%	104.710	99.186	16.04. 16.10.	5.000	25.041 24.379	N
	EUR	1'000.00	27.10.2011	25.10.2019	14 185 559	%	107.370	99.049	25.10.	4.125	48.231	N
	USD	1'000.00	30.03.2010	30.03.2020	11 585 051	%	105.300	99.356	30.03. 30.09.	5.000	24.903 24.336	N
	EUR	1'000.00	12.07.2012	12.07.2021	18 968 589	%	109.210	99.977	12.07.	3.000	33.031	N
	EUR	1'000.00	28.06.2010	28.06.2022	11 453 783	%	118.800	98.902	28.06.	4.750	51.824	N
American International Group, Inc., New York, USA	USD	1'000.00	16.07.2012	16.07.2022	19 009 210	%	101.000	99.490	16.01. 16.07.	3.125	15.796 15.046	N
	CHF	5'000.00	29.06.2007	29.06.2017	3 139 047		-	100.500	29.06.	3.375	168.75	N
Amgen Inc., Thousand Oaks, USA												
	EUR	1'000.00	25.02.2016	25.02.2022	31 659 522	%	103.500	99.971	25.02.	1.250	13.376	N
	CHF	5'000.00	08.03.2016	08.03.2023	31 420 936	%	101.200	100.000	08.03.	0.410	20.500	N
Anglian Water (Osprey) Financing PLC, Huntingdon, Grossbritannien	USD	1'000.00	10.11.2011	15.11.2041	14 287 437	%	118.060	99.168	15.05. 15.11.	5.150	25.663 25.484	N
	GBP	1'000.00	31.01.2011	31.01.2018	12 388 282	%	100.370	100.000	31.01. 31.07.	7.000	43.442 44.521	N
Anglo American Capital PLC, London, Grossbritannien												
Emissionsdisagio von 0.219% 3.4.2017 Em.preis: 99.781%	USD	1'000.00	02.04.2012	03.04.2017	18 297 399		-	99.781	03.04. 03.04.	2.625	13.165 2.196	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	USD	1'000.00	27.09.2012	27.09.2017	19 624 992		-	99.949	27.03. 27.09.	2.625	12.906 12.793	N
Emissionsdisagio von 0.051% 27.9.2017 Em.preis: 99.949%									27.09.		0.49711	
	GBP	1'000.00	01.05.2008	01.05.2018	3 987 789	%	101.760	99.300	01.05.	6.875	88.346	N
21.3.2017 Rückkauf ausstehender Titel												
	EUR	1'000.00	18.09.2012	18.09.2018	19 503 317	%	101.700	99.862	18.09.	2.500	28.698	N
	USD	1'000.00	08.04.2009	08.04.2019	10 099 776	%	108.670	100.000	08.04. 08.10.	9.375	47.253 45.918	N
	EUR	1'000.00	07.06.2012	07.06.2019	18 716 951	%	103.640	99.975	07.06.	2.750	29.849	N
	EUR	1'000.00	01.04.2015	01.04.2020	27 698 392	%	102.770	99.690	01.04.	1.500	16.027	N
	USD	1'000.00	27.09.2010	27.09.2020	11 781 983	%	104.000	99.976	27.03. 27.09.	4.450	21.879 21.687	N
	EUR	1'000.00	29.04.2013	29.04.2021	21 241 433	%	106.300	99.379	29.04.	2.500	27.128	N
	EUR	1'000.00	27.03.2012	28.03.2022	18 240 555	%	110.860	99.734	28.03.	3.500	37.411	N
	USD	1'000.00	27.09.2012	27.09.2022	19 625 009	%	100.630	99.248	27.03. 27.09.	4.125	20.282 20.103	N
Anheuser Busch Inbev Worldwide Inc, Wilmington, USA												
	USD	1'000.00	16.07.2012	15.07.2017	19 034 410		-	99.712	15.01. 15.07.	1.375	6.950 6.620	N
Emissionsdisagio von 0.288% 15.7.2017 Em.preis: 99.712%									15.07.		2.773	
	USD	1'000.00	16.07.2012	15.07.2022	19 034 418	%	99.260	99.518	15.01. 15.07.	2.500	12.637 12.037	N
Anheuser-Busch Inbev Finance Inc, New York, USA												
	USD	1'000.00	17.01.2013	17.01.2018	20 465 576		-	99.427	17.01. 17.07. 10.11.	1.250	6.266 6.018 3.902	N
Emissionsdisagio von 0.573% 10.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung									10.11.		5.699	
	CAD	1'000.00	25.01.2013	25.01.2018	20 540 819	%	100.050	100.000	25.01. 25.07.	2.375	9.064 8.991	N
	USD	1'000.00	25.01.2016	01.02.2019	31 118 562	%	99.620	99.729	01.02. 01.08.	1.900	9.427 9.173	N
	USD	1'000.00	25.01.2016	01.02.2021	31 118 563	%	100.320	99.687	01.02. 01.08.	2.650	13.148 12.795	N
	USD	1'000.00	25.01.2016	01.02.2023	31 118 571	%	101.990	99.621	01.02. 01.08.	3.300	16.373 15.933	N
	USD	1'000.00	25.01.2016	01.02.2026	31 118 407	%	102.170	99.833	01.02. 01.08.	3.650	18.110 17.623	N
	USD	1'000.00	25.01.2016	01.02.2036	31 118 559	%	109.360	99.166	01.02. 01.08.	4.700	23.319 22.693	N
	USD	1'000.00	27.01.2014	01.02.2044	23 499 859	%	110.260	99.533	01.02. 01.08.	4.625	22.947 22.330	N
	USD	1'000.00	25.01.2016	01.02.2046	31 118 561	%	114.800	99.765	01.02. 01.08.	4.900	24.312 23.658	N
Anheuser-Busch InBev SA/NV, Bruxelles, Belgien												
	EUR	1'000.00	25.09.2012	24.03.2017	19 592 250		-	99.668	24.03. 24.03.	1.250	13.388 3.555	N
Emissionsdisagio von 0.332% 24.3.2017 Em.preis: 99.668%												
	GBP	1'000.00	23.06.2009	23.06.2017	10 276 846		-	99.241	23.06. 23.06.	6.500	80.214 9.366	N
Emissionsdisagio von 0.759% 23.6.2017 Em.preis: 99.241%												
	EUR	1'000.00	26.04.2010	26.04.2018	11 230 553	%	101.240	99.550	26.04.	4.000	43.274	N
	EUR	1'000.00	25.09.2012	16.12.2019	19 592 244	%	103.700	99.538	16.12.	2.000	23.283	N
	EUR	1'000.00	24.09.2013	24.09.2020	22 389 317	%	105.800	99.859	25.09.	2.250	25.949	N
	EUR	1'000.00	02.06.2011	02.06.2021	13 097 741	%	113.110	99.024	02.06.	4.000	43.470	N
	EUR	1'000.00	31.03.2014	30.09.2021	24 049 877	%	106.300	99.991	30.09.	1.950	22.277	N
	EUR	1'000.00	20.04.2015	20.04.2023	27 057 257	%	101.690	99.500	20.04.	0.800	8.570	N
	EUR	1'000.00	25.09.2012	25.09.2024	19 590 545	%	114.090	98.993	25.09.	2.875	33.066	N
	EUR	1'000.00	29.03.2016	17.03.2025	31 955 606	%	105.080	99.676	17.03.	1.500	15.550	N
	EUR	1'000.00	31.03.2014	31.03.2026	24 049 887	%	113.040	99.848	31.03.	2.700	28.904	N
	EUR	1'000.00	23.01.2013	24.01.2033	20 514 867	%	118.560	98.902	24.01.	3.250	35.015	N
Anthem Inc., Indianapolis, USA												
	USD	1'000.00	12.08.2014	15.08.2019	25 159 579	%	99.370	99.769	15.02. 15.08.	2.250	11.344 10.944	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
ANZ New Zealand (Intl) Limited, London, Grossbritannien												
	CHF	5'000.00	27.02.2012	27.02.2018	14 918 245	%	100.340	100.568	27.02.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	14.02.2013	14.02.2019	20 528 770	%	101.510	100.500	14.02.	0.875	43.750	N
	CHF	5'000.00	10.03.2014	10.03.2020	23 448 738	%	102.800	100.139	10.03.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	25.02.2016	25.10.2023	31 045 182	%	100.800	100.342	25.10.	0.250	12.500	N
	CHF	5'000.00	22.03.2017	22.09.2025	35 752 043	%	99.850	100.421	22.09.	0.250	6.250	N
Apple Inc., Cupertino, USA												
	USD	1'000.00	13.05.2015	12.05.2017	28 185 181		-	99.931	12.05.	0.900	8.999	N
Emissionsdisagio von 0.069% 12.5.2017 Em.preis: 99.931%									12.05.		0.69186	
	USD	1'000.00	03.05.2013	03.05.2018	21 311 603	%	99.520	99.631	03.05.	1.000	4.955	N
									03.11.		5.001	
	AUD	10'000.00	28.08.2015	28.08.2019	29 347 709	%	100.370	100.000	28.02.	VAR.	46.770	N
									30.05.		44.056	
									28.08.		44.650	
	AUD	10'000.00	28.08.2015	28.08.2019	29 348 870	%	100.770	99.887	28.02.	2.850	110.61	N
									28.08.		107.30	
	USD	1'000.00	13.05.2015	06.05.2020	28 185 185	%	98.950	99.845	13.05.	2.000	9.966	N
									13.11.		9.954	
	AUD	10'000.00	10.06.2016	10.06.2020	32 822 348	%	100.700	99.901	10.06.	2.650	96.602	N
									10.12.		99.267	
	USD	1'000.00	23.02.2016	23.02.2021	31 618 396	%	99.860	99.929	23.02.	2.250	11.314	N
									23.08.		10.855	
	USD	1'000.00	13.05.2015	13.05.2022	28 185 186	%	100.140	99.816	13.05.	2.700	13.454	N
									13.11.		13.439	
	AUD	10'000.00	28.08.2015	28.08.2022	29 347 732	%	103.510	99.939	28.02.	3.700	143.61	N
									28.08.		139.30	
	EUR	1'000.00	10.11.2014	10.11.2022	26 006 964	%	103.530	99.375	10.11.	1.000	11.601	N
	USD	1'000.00	23.02.2016	23.02.2023	31 618 401	%	100.800	99.893	23.02.	2.850	14.332	N
									23.08.		13.750	
	USD	1'000.00	03.05.2013	03.05.2023	21 311 623	%	99.180	99.867	03.05.	2.400	11.894	N
									03.11.		12.003	
	AUD	10'000.00	10.06.2016	10.01.2024	32 822 344	%	101.530	99.932	10.01.	3.350	126.37	N
									10.07.		121.97	
	CHF	5'000.00	25.02.2015	25.11.2024	27 117 168	%	101.950	100.907	25.11.	0.375	18.750	N
	USD	1'000.00	09.02.2015	09.02.2025	27 018 526	%	97.300	99.859	09.02.	2.500	12.509	N
									09.08.		12.073	
	USD	1'000.00	13.05.2015	13.05.2025	28 185 187	%	101.840	99.652	13.05.	3.200	15.946	N
									13.11.		15.927	
	USD	1'000.00	04.08.2016	04.08.2026	33 461 312	%	95.830	99.727	04.02.	2.450	12.160	N
									04.08.		11.918	
	EUR	1'000.00	10.11.2014	10.11.2026	26 005 631	%	106.120	99.504	10.11.	1.625	18.851	N
	CHF	5'000.00	25.02.2015	25.02.2030	27 117 169	%	102.950	100.142	25.02.	0.750	37.500	N
	USD	1'000.00	03.05.2013	04.05.2043	21 311 624	%	103.570	99.418	04.05.	3.850	19.073	N
									04.11.		19.260	
	USD	1'000.00	13.05.2015	13.05.2045	28 185 189	%	111.830	99.635	13.05.	4.375	21.801	N
									13.11.		21.776	
Apt Pipelines Ltd, Sydney, Australien												
	AUD	100.00	18.09.2012	30.09.2072	19 256 121	CHF	76.050	100.000	31.03.	VAR.	1.186	N
									30.06.		1.152	
									02.10.		1.192	
Aquarius + Investments PLC, Dublin, Irland												
	USD	5'000.00	29.03.2012		18 266 732	%	103.460	100.000	01.09.	8.250	397.08	N
ArcelorMittal S.A., Luxemburg												
	EUR	1'000.00	18.11.2010	17.11.2017	12 015 250		-	99.317	17.11.	VAR.	68.593	N
Emissionsdisagio von 0.683% 17.11.2017 Em.preis: 99.317%									17.11.		7.974	
	EUR	1'000.00	29.03.2012	29.03.2018	18 266 703	%	101.600	99.712	29.03.	VAR.	61.631	N
	USD	1'000.00	01.06.2015	01.06.2020	28 407 013	%	104.500	100.000	01.06.	5.125	24.842	N
									01.12.		25.219	
	CHF	5'000.00	03.07.2015	03.07.2020	28 728 247	%	104.800	100.000	03.07.	2.500	125.00	N
	EUR	1'000.00	04.07.2014	06.07.2020	24 825 386	%	106.650	99.182	06.07.	2.875	31.574	N
	USD	1'000.00	05.08.2010	05.08.2020	11 599 693	%	105.820	98.459	05.02.	VAR.	31.021	N
									05.08.		27.956	
Notes Sr	USD	1'000.00	28.02.2012	25.02.2022	18 067 687	%	111.410	99.284	25.02.	VAR.	35.196	N
									25.08.		34.741	

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Arkea Public Sector SCF, LE RELECQ KERHUON, Frankreich												
	EUR	100'000.00	07.10.2011	07.10.2021	13 990 935	%	114.500	99.566	07.10.	3.750	4'311.75	N
Arla Foods Finance A/S, Viby, Dänemark												
	SEK	1'000'000.00	28.05.2014	28.05.2019	24 532 580	%	100.810	100.000	28.02. 29.05. 28.08. 28.11.	VAR.	158.27 187.47 197.44 214.59	N
Aryzta Euro Finance DAC, Dublin, Irland												
	EUR	1'000.00	21.11.2014		26 113 343	%	97.090	99.540	28.03.	4.500	48.100	N
ASB Finance Ltd, Auckland, Neuseeland												
	CHF	5'000.00	02.02.2017	02.08.2024	35 003 041	%	100.300	100.531	02.08.	0.200	5.000	N
ASB Finance Ltd, London Branch, London, Grossbritannien												
	CHF	5'000.00	02.05.2012	02.11.2018	18 338 072	%	101.690	100.888	02.11.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	11.06.2013	11.06.2019	21 402 760	%	101.850	100.573	11.06.	0.875	43.750	N
	CHF	5'000.00	05.02.2014	05.02.2020	23 322 626	%	103.200	100.341	05.02.	1.125	56.250	N
Asea Brown Boveri Financ - ABB Finance BV, Rotterdam, Niederlande												
	EUR	1'000.00	26.03.2012	26.03.2019	18 228 978	%	103.150	99.905	26.03.	2.625	28.096	N
Asiatische Entwicklungsbank (Asian Development Bank), Manila, Philippinen												
Emissionsdisagio von 0.165% 15.6.2017 Em.preis: 99.835%	CAD	1'000.00	15.06.2007	15.06.2017	3 191 258		-	99.835	15.06. 15.06.	4.750	17.361 1.209	N
Emissionsdisagio von 0.273% 5.7.2017 Em.preis: 99.727%	AUD	5'000.00	05.07.2012	05.07.2017	18 942 644		-	99.727	05.01. 05.07. 05.07.	3.500	65.447 63.545 9.995	N
	ZAR	50'000.00	28.06.2012	29.06.2018	19 214 058	%	97.410	100.000	29.06. 29.12.	5.000	92.172 98.391	N
	AUD	5'000.00	25.01.2013	25.07.2018	20 526 459	%	100.800	99.554	25.01. 25.07.	3.500	66.594 65.397	N
	USD	1'000.00	20.10.2011	23.10.2018	14 106 568	%	100.020	99.837	23.04. 23.10.	1.875	9.333 9.242	N
	AUD	5'000.00	22.05.2014	22.05.2019	24 475 681	%	101.990	99.818	22.05. 22.11.	3.500	63.187 65.803	N
	NZD	1'000.00	28.01.2015	28.01.2020	26 782 696	%	102.930	99.568	28.01. 28.07.	3.875	14.183 13.976	N
	CNY	500'000.00	21.10.2010	21.10.2020	11 919 125	%	96.000	100.000	21.04. 21.10.	2.850	1'031.00 1'060.96	N
	AUD	5'000.00	19.01.2017	19.01.2022	35 381 311	%	100.390	99.942	19.07.	2.750	51.664	N
	AUD	1'000.00	09.03.2012	09.03.2022	18 119 161	%	109.460	98.781	09.03. 09.09.	5.000	18.862 19.264	N
	NZD	1'000.00	30.05.2017	30.05.2024	36 911 653	%	101.180	99.981	30.11.	3.500	11.889	N
ASIF II, Cayman Islands, Kaimaninseln	CHF	5'000.00	12.02.2010	12.02.2030	10 915 626	%	129.900	101.561	12.02.	2.750	137.50	N
	GBP	1'000.00	05.10.2000	05.10.2020	1 133 869	%	112.730	99.617	05.10.	6.375	81.912	N
Assicurazioni Generali S.p.A., Trieste, Italien												
	EUR	1'000.00	16.09.2009	16.09.2024	10 548 477	%	128.370	98.552	16.09.	5.125	58.832	N
	EUR	100'000.00	02.05.2014	04.05.2026	24 315 742	%	116.420	99.073	04.05.	4.125	4'473.76	N
	EUR	100'000.00	12.12.2012	12.12.2042	20 197 733	%	129.190	100.000	12.12.	7.750	9'022.93	N
AstraZeneca PLC, London, Grossbritannien												
	USD	1'000.00	18.09.2012	18.09.2019	19 505 657	%	98.360	99.876	18.03. 18.09.	1.950	9.717 9.362	N
Atrium European Real Estate Limited, St Helier, Jersey	GBP	1'000.00	13.11.2007	13.11.2031	3 542 237	%	137.680	99.574	13.11.	5.750	75.050	N
	EUR	1'000.00	19.04.2013	20.04.2020	21 172 311	%	107.460	99.569	20.04.	4.000	42.852	N
AT&T Inc., Dallas, USA												
Emissionsdisagio von 0.12% 15.2.2017 Em.preis: 99.88%	USD	1'000.00	13.02.2012	15.02.2017	14 970 399		-	99.880	15.02. 15.02.	1.600	8.067 1.210	N
Emissionsdisagio von 0.203% 28.4.2017 Em.preis: 99.797%	GBP	50'000.00	30.04.2009	28.04.2017	10 149 656		-	99.797	28.04. 28.04.	5.875	3'783.11 130.71	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	USD	1'000.00	14.06.2012	01.06.2017	18 817 841		-	99.806	01.06. 01.06.	1.700	8.240 1.880	N
Emissionsdisagio von 0.194% 1.6.2017 Em.preis: 99.806%												
	USD	1'000.00	11.12.2012	01.12.2017	20 218 067		-	99.995	01.06. 01.12. 01.12.	1.400	6.786 6.889 0.0492	N
Emissionsdisagio von 0.005% 1.12.2017 Em.preis: 99.995%												
	USD	1'000.00	01.02.2008	01.02.2018	3 748 988	%	100.260	99.780	01.02. 01.08.	5.500	27.289 26.555	N
	USD	1'000.00	03.02.2009	15.02.2019	1 795 691	%	103.610	99.689	15.02. 15.08.	5.800	29.244 28.213	N
	USD	1'000.00	10.03.2014	11.03.2019	23 901 528	%	99.950	99.995	13.03. 11.09.	2.300	11.578 10.826	N
	CHF	5'000.00	26.11.2014	04.12.2019	26 076 938	%	101.400	100.167	04.12.	0.500	25.000	N
	EUR	1'000.00	04.12.2012	04.12.2020	20 136 383	%	104.670	99.099	04.12.	1.875	21.880	N
	USD	1'000.00	29.04.2011	15.05.2021	12 930 182	%	105.500	99.925	15.05. 15.11.	4.450	22.174 22.020	N
	USD	1'000.00	13.02.2012	15.02.2022	14 970 398		-	99.803	15.02. 15.08.	3.000	15.126 14.592	N
	USD	1'000.00	11.12.2012	01.12.2022	20 218 070	%	98.000	99.922	01.06. 01.12.	2.625	12.723 12.917	N
	EUR	1'000.00	13.03.2013	15.03.2023	20 900 229	%	108.600	99.790	15.03.	2.500	26.791	N
	CHF	5'000.00	26.11.2014	04.12.2024	26 076 942	%	105.800	100.055	04.12.	1.375	68.750	N
	GBP	50'000.00	15.03.2007	15.03.2027	2 989 308	%	122.460	98.703	15.03.	5.500	3'388.37	N
	CHF	5'000.00	26.11.2014	04.12.2030	26 076 944	%	110.700	101.023	04.12.	1.875	93.750	N
	USD	1'000.00	03.11.2004	15.09.2034	1 987 043		-	99.778	15.03. 15.09. 30.10.	6.150	30.998 29.529 2.213	N
Emissionsdisagio von 0.222%												
	USD	1'000.00	10.06.2014	15.06.2044	24 617 508	%	97.980	99.636	15.06. 15.12.	4.800	23.396 23.804	N
	USD	1'000.00	04.05.2015	15.05.2046	28 028 752	%	97.000	99.644	15.05. 15.11.	4.750	23.669 23.505	N
Auchan Holding SA, Croix, Frankreich												
	EUR	50'000.00	15.11.2010	15.11.2017	12 006 326		-	99.482	15.11. 15.11.	2.875	1'678.92 302.49	N
Emissionsdisagio von 0.518% 15.11.2017 Em.preis: 99.482%												
	EUR	100'000.00	20.06.2011	19.10.2018	13 182 080	%	102.900	99.799	19.10.	VAR.	4'186.87	N
	EUR	50'000.00	15.04.2009	15.04.2019	10 097 614	%	107.830	99.319	15.04.	6.000	3'204.45	N
	EUR	100'000.00	12.12.2012	12.12.2022	20 195 527	%	109.070	99.587	12.12.	2.375	2'765.09	N
	CHF	5'000.00	03.06.2014	03.06.2024	24 471 797	%	106.250	100.954	03.06.	1.500	75.000	N
Auckland Council, Neuseeland												
	CHF	5'000.00	07.02.2013	07.02.2024	20 401 700	%	107.350	100.853	07.02.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	28.03.2014	28.11.2025	23 876 511	%	111.150	101.036	28.11.	1.500	75.000	N
Ausnet Services Holdings Pty Ltd, Southbank, Australien												
	CHF	5'000.00	21.02.2012	21.02.2017	14 383 835		-	100.021	21.02.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	18.12.2012	18.04.2019	20 025 281	%	101.710	100.739	18.04.	1.125	56.250	N
	AUD	10'000.00	14.02.2013	14.02.2020	20 671 916	%	104.440	99.682	14.02. 14.08.	5.250	203.44 198.67	N
Australia, Australien												
	AUD	1'000.00	06.12.2013	21.10.2018	23 083 776	%	101.090	100.000	21.04. 21.10.	3.250	12.208 12.504	N
	AUD	1'000.00	29.04.2009	15.04.2020	10 160 592	%	105.400	100.000	15.04. 15.10.	4.500	17.094 17.299	N
"reine Differenzbesteuerung"	AUD	1'000.00	28.02.2012	21.02.2022	18 052 979	%	114.630	98.906	21.02. 21.05. 21.08. 21.11.	VAR.	2.418 2.275 2.383 2.350	Y
	AUD	1'000.00	11.05.2016	21.05.2028	32 560 721	%	96.170	97.167	21.05. 21.11.	2.250	8.124 8.531	N
Australia and New Zealand Banking Group Limited, Melbourne, Australien												
	NZD	2'000.00	11.04.2012	11.04.2017	18 329 154		-	100.842	11.04.	5.000	69.872	N
	NOK	10'000.00	23.05.2012	23.05.2017	18 588 666		-	101.510	23.05.	3.750	43.655	N
	AUD	2'000.00	25.07.2012	25.07.2017	19 034 442		-	101.475	25.07.	5.000	75.359	N
	CHF	5'000.00	27.04.2011	27.10.2017	12 786 022		-	100.264	27.10.	2.625	131.25	N
	AUD	2'000.00	07.02.2013	07.02.2018	20 548 394	%	100.220	101.246	07.02.	4.125	63.037	N
	CAD	1'000.00	10.12.2013	10.12.2018	22 987 649	%	100.670	101.535	10.12.	2.625	20.232	N
	CHF	5'000.00	13.02.2012	13.02.2019	14 383 803	%	102.410	100.533	13.02.	1.500	75.000	N
	NZD	2'000.00	13.03.2014	13.03.2019	23 845 576	%	103.010	101.388	13.03.	5.250	73.231	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	AUD	1'000.00	25.07.2014	25.07.2019	25 002 065	%	102.120	99.168	25.01. 25.07.	3.750	14.270 14.013	N
	AUD	2'000.00	06.08.2013	06.08.2019	21 927 283	%	103.650	101.110	06.08.	4.750	73.045	N
	NZD	2'000.00	22.10.2013	22.10.2019	22 559 228	%	105.320	101.362	22.10.	5.625	77.222	N
	NZD	2'000.00	06.08.2014	08.12.2019	25 043 445	%	104.230	99.888	08.12.	5.125	69.780	N
	AUD	2'000.00	03.02.2014	03.02.2020	23 467 969	%	104.260	101.576	03.02.	4.750	72.581	N
	NZD	2'000.00	03.02.2015	03.02.2020	26 937 766	%	102.780	101.022	03.02.	4.250	61.869	N
	AUD	2'000.00	18.12.2013	18.12.2020	23 082 798	%	106.660	101.411	18.12.	5.250	79.420	N
	AUD	2'000.00	19.03.2014	19.03.2021	23 909 151	%	106.370	101.132	19.03.	4.875	75.144	N
	NZD	1.00	22.03.2016	22.03.2021	31 883 215	%	103.850	100.000	22.03. 22.09.	4.000	0.01385 0.01433	N
	EUR	1'000.00	18.01.2012	18.07.2022	14 714 453	%	115.540	99.271	18.07.	3.625	40.009	N
Autobahnen- und Schnellstrassenfinanzierungs-AG Asfinag, Wien, Österreich												
	EUR	1'000.00	16.10.2007	16.10.2017	3 469 138		-	99.550	16.10. 16.10.	4.500	51.770 5.177	N
Emissionsdisagio von 0.45% 16.10.2017 Em.preis: 99.55%												
Avianca Holdings S.A. / Avianca Leasing LLC / Grupo Taca Holdings Ltd, Panama												
	USD	1'000.00	10.05.2013	10.05.2020	21 333 406	%	99.870	98.706	10.05. 10.11.	8.375	42.227 41.654	N
Avis Budget Finance PLC, St Helier, Jersey												
	EUR	1'000.00	26.09.2016	15.11.2024	34 061 644	%	102.100	100.000	15.05. 15.11.	4.125	28.710 24.088	N
Aviva plc, London, Grossbritannien												
	EUR	1'000.00	03.07.2014	03.07.2044	24 806 445	%	112.670	99.699	03.07.	3.875	42.425	N
AXA SA, Paris, Frankreich												
	USD	1'000.00	06.02.2004		1 783 459	%	87.810	100.000	06.02. 06.08.	VAR.	7.112 11.698	N
AYT Cedulas Cajas Global, Fondo de Titulizacion de Activos, Madrid, Spanien												
	EUR	100'000.00	02.12.2009	02.12.2019	10 783 485	%	109.000	98.185	02.12.	4.500	5'251.27	N
AYT Cedulas Cajas V, Fondo de Titulizacion de Activos, Madrid, Spanien												
	EUR	100'000.00	04.12.2003	04.12.2018	1 735 224	%	104.540	100.000	04.12.	4.750	5'543.01	N
AYT Cedulas Cajas VIII, Fondo de Titulizacion de Activos, Madrid, Spanien												
	EUR	100'000.00	18.11.2004	18.11.2019	1 999 806	%	108.180	100.000	18.11.	4.250	4'948.48	N
A2A SpA, Milano, Italien												
	EUR	1'000.00	28.11.2012	28.11.2019	20 111 017	%	109.040	99.718	28.11.	4.500	52.560	N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
BA Covered Bond Issuer, New York, USA												
Emissionsdisagio von 0.773% 5.4.2017 Em.preis: 99.227%	EUR	50'000.00	05.04.2007	05.04.2017	3 032 103		-	99.227	05.04. 05.04.	4.250	45.498 413.76	N
Bacardi Ltd, Hamilton, Bermuda												
31.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	03.07.2013	03.07.2023	21 699 854		-	100.000	03.07. 31.08.	2.750	30.108 5.078	N
Baidu, Inc., George Town, Kaimaninseln												
Emissionsdisagio von 0.071% 28.11.2017 Em.preis: 99.929%	USD	1'000.00	28.11.2012	28.11.2017	20 085 977		-	99.929	28.05. 28.11. 28.11.	2.250	10.982 0.69878 11.072	N
Banca CARIGE S.p.A., Genova, Italien												
	EUR	1'000.00	20.12.2010	20.12.2020	12 192 870	%	63.000	100.000	20.12.	7.321	85.659	N
Banca del Mezzogiorno-MedioCredito Centrale S.p.A., Roma, Italien												
	EUR	0.010	10.02.1998	10.02.2028	955 811	%	80.950	17.524		0.000	0.000	Y
Banca di Credito Cooperativo di Carate Brianza SCRL, Carate Brianza, Italien												
	EUR	1'000.00	02.05.2014	02.11.2017	24 380 631		-	100.000	02.05. 02.11.	2.000	10.835 11.646	N
Banca di Credito Cooperativo Pordenonese, Azzano Decimo (PN), Italien												
	EUR	1'000.00	01.09.2015	01.03.2020	29 789 785		n.v.	100.000	01.03. 01.09.	1.100	5.857 6.289	N
Banca IMI S.p.A., Milano, Italien												
	GBP	1'000.00	14.05.2015	14.05.2022	28 271 863	%	97.520	99.630	14.05.	VAR.	42.483	N
	EUR	1'000.00	26.01.2016	26.01.2026	31 311 280	%	98.810	99.220	26.01.	3.100	33.187	N
	EUR	1'000.00	10.05.2016	10.05.2026	32 553 214	%	100.460	99.420	10.05.	2.200	24.113	N
Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A., Siena, Italien												
	EUR	1'000.00	09.02.2011	09.02.2018	12 454 012	%	100.540	99.677	09.02.	5.000	53.508	N
28.7.2017 Titelumtausch: 50'000 5 Monte Paschi 20 5 % Subordinated Notes 2010-21.4.20 Reg-S Series 2010/4 Subord. = 5'780.346821 Banca MPS N Az nominativa (VN 37752277)	EUR	50'000.00	21.04.2010	21.04.2020	11 223 986		-	99.010	21.04.	5.000	2'668.62	N
Banca Popolare di Sondrio S.c.p.A., Sondrio, Italien												
	EUR	1'000.00	31.07.2013	31.07.2018	21 888 505	%	101.580	100.000	31.01. 31.07.	3.250	17.468 18.334	N
Banca Popolare Friuladria SpA, Pordenone, Italien												
	EUR	1'000.00	01.06.2012	01.06.2018	18 813 298	%	101.690	100.000	01.06.	4.000	43.530	N
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria Chile, Santiago, Chile												
	CHF	5'000.00	09.05.2014	09.05.2017	24 221 485		-	100.452	09.05.	1.375	68.750	N
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria, S.A., Bilbao, Spanien												
	EUR	100'000.00	24.01.2006	24.01.2021	2 415 104	%	110.530	98.054	24.01.	3.500	3'770.87	N
	EUR	100'000.00	25.02.2005	25.02.2025	2 076 518	%	124.280	97.107	25.02.	4.000	4'280.48	N
Banco BPM S.p.A., Milano, Italien												
	EUR	1'000.00	29.01.2016	29.01.2021	30 901 847	%	96.460	100.000	29.01. 29.04. 29.07. 29.10.	2.500	6.662 6.782 7.110 7.245	N
Banco BTG Pactual Luxembourg S.A., Luxemburg												
1.11.2017 Rückkauf ausstehender Titel: 1'000 = USD 1'000.00 in bar	USD	1'000.00	18.09.2014		25 451 562	%	100.980	100.000	18.03. 18.09.	8.750	43.603 42.011	N
Banco BTG Pactual SA, Cayman Islands Branch, George Town, Kaimaninseln												
Tranche 2 Reg S	USD	1'000.00	16.01.2013	16.01.2020	20 434 636	%	98.450	99.247	16.01. 16.07.	4.000	20.219 19.259	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Banco de Chile, Santiago, Chile												
	CHF	5'000.00	25.07.2013	25.07.2017	21 757 973		-	100.277	25.07.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	23.05.2013	23.05.2018	21 277 160	%	100.670	100.694	23.05.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	21.03.2014	21.03.2019	23 833 943	%	101.870	100.451	21.03.	1.250	62.500	N
	CHF	5'000.00	03.12.2013	03.12.2019	22 820 757	%	103.500	100.251	03.12.	1.500	75.000	N
Banco de Credito e Inversiones SA, Santiago, Chile												
	CHF	5'000.00	25.11.2014	23.11.2018	26 029 661	%	101.260	100.531	23.11.	0.875	43.750	N
	CHF	5'000.00	26.06.2014	26.06.2019	24 678 818	%	101.800	100.438	26.06.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	17.06.2015	17.06.2020	27 887 596	%	100.400	100.485	17.06.	0.250	12.500	N
Banco Del Estado De Chile, Santiago, Chile												
	CHF	5'000.00	07.04.2017	07.04.2027	36 017 270	%	99.250	100.000		0.575	0.000	N
Banco do Brasil SA Grand Cayman Branch, George Town, Kaimaninseln												
	USD	1'000.00	18.06.2014		24 686 432	%	106.750	100.000	18.06. 18.12.	9.000	43.581 44.348	N
Tranche 13 Reg S	BRL	1'000.00	18.07.2007	18.07.2017	3 269 305		-	100.000	18.01. 18.07.	9.750	26.080 24.814	N
	EUR	1'000.00	25.07.2013	25.07.2018	21 942 319	%	101.700	99.442	25.07.	3.750	41.493	N
	CHF	5'000.00	20.12.2013	20.06.2019	22 975 192	%	102.550	100.179	20.06.	2.500	125.00	N
Banco General SA, Panama												
	CHF	5'000.00	18.06.2014	18.06.2018	24 513 895	%	100.570	100.542	18.06.	1.625	81.250	N
Banco Popolare-Società Cooperativa, Verona, Italien												
Emissionsdisagio von 0.599% 31.3.2017 Em.preis: 99.401%	EUR	50'000.00	05.08.2010	31.03.2017	11 085 567		-	99.401	31.03. 31.03.	3.625	1'940.37 320.62	N
	EUR	1'000.00	05.11.2010	05.11.2020	11 955 452	%	107.450	99.648	05.11.	6.000	69.555	N
	EUR	1'000.00	31.05.2011	31.05.2021	13 107 839	%	108.000	99.259	31.05.	6.375	69.360	N
Banco Safra SA, Kaimaninseln												
	CHF	5'000.00	27.03.2014	27.06.2017	23 448 741		-	100.000	27.06.	1.850	92.500	N
	CHF	5'000.00	11.12.2014	11.12.2019	25 589 302	%	100.650	100.175	11.12.	1.500	75.000	N
Banco Santander, S.A., Boadilla del Monte, Spanien												
Emissionsdisagio von 0.222% 27.3.2017 Em.preis: 99.778%	EUR	100'000.00	27.03.2002	27.03.2017	1 399 447		-	99.778	27.03. 27.03.	5.750	6'154.51 237.61	N
Emissionsdisagio von 0.046% 6.4.2017 Em.preis: 99.954%	EUR	100'000.00	06.04.2010	06.04.2017	11 152 047		-	99.954	06.04. 06.04.	3.625	3'878.93 49.222	N
	CHF	5'000.00	12.06.2017	12.06.2023	36 720 668	%	102.000	100.044		0.750	0.000	N
	CHF	5'000.00	20.07.2017	20.07.2027	37 283 153	%	102.150	100.614		1.125	0.000	N
Banco Santander-Chile, Santiago, Chile												
	CHF	5'000.00	28.03.2013	28.03.2017	20 899 195		-	100.000	28.03.	VAR.	3.360	N
	CHF	5'000.00	31.01.2014	31.07.2017	22 931 810		-	100.341	31.07.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	26.09.2013	26.09.2019	21 507 635	%	103.150	100.365	26.09.	1.750	87.500	N
	CHF	5'000.00	19.05.2015	19.05.2022	28 056 746	%	100.300	100.086	19.05.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	30.11.2016	30.05.2025	34 646 177	%	99.500	100.000	30.05.	0.350	8.750	N
Bank für Tirol und Vorarlberg AG, Innsbruck, Österreich												
	EUR	100.00	18.08.2009	18.08.2017	10 447 668		-	100.000	18.08.	3.000	3.390	N
	EUR	100.00	12.03.2010	12.03.2018	11 108 868		n.v.	98.625	12.03.	4.500	2.148	N
Bank of America Corporation, Charlotte, USA												
Emissionsdisagio von 0.504% 7.8.2017 Em.preis: 99.496%	EUR	50'000.00	05.08.2010	07.08.2017	11 591 882		-	99.496	07.08. 07.08.	4.625	2'652.43 289.04	N
	CHF	5'000.00	28.09.2005	28.09.2017	2 259 521		-	100.415	28.09.	2.500	125.00	N
	EUR	50'000.00	28.03.2006	28.03.2018	2 501 100	%	99.620	99.874	28.03. 28.06. 28.09. 28.12.	VAR.	69.884 71.103 74.461 75.477	N
	GBP	50'000.00	30.04.2008	30.04.2018	3 987 887	%	102.240	99.609	30.04.	7.750	4'979.51	N
4.12.2017 Titelumtausch:	USD	1'000.00	15.07.1998	15.07.2018	932 973	%	101.090	99.150	15.01. 15.07.	6.500	32.857 31.297	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	AUD	10'000.00	23.05.2013	23.08.2018	21 413 654	%	101.310	99.299	23.02. 23.08.	4.500	176.24 170.03	N
	EUR	1'000.00	06.05.2004	06.05.2019	1 850 306	%	101.520	99.781	06.02. 08.05. 07.08. 06.11.	VAR.	3.123 3.052 3.314 3.350	N
	GBP	1'000.00	04.12.2003	04.12.2019	1 729 745	%	108.410	99.506	04.06. 04.12.	5.500	34.210 36.600	N
	GBP	50'000.00	24.09.2009	15.09.2021	10 580 346	%	116.890	99.734	15.03. 15.09.	6.125	1'871.19 2'015.38	N
	USD	1'000.00	11.01.2013	11.01.2023	20 423 878	%	102.100	99.444	11.01. 11.07.	3.300	16.889 15.979	N
	GBP	50'000.00	31.07.2008	31.07.2028	4 448 787	%	144.260	98.993	31.01. 31.07.	7.000	2'189.97 2'207.80	N
Bank of China Ltd, Singapore Branch, Singapore, Singapur												
	CNY	10'000.00	04.03.2014	04.03.2019	23 824 282	%	99.200	100.000	04.03. 04.09.	4.000	29.099 29.568	N
Bank of China (Luxembourg) S.A., Luxemburg												
	CNY	10'000.00	15.05.2014	15.05.2017	24 431 734		-	100.000	15.05.	3.500	25.077	N
Bank of Communications Co Ltd, Hong Kong Branch, Hong Kong, Hongkong												
	CHF	5'000.00	26.06.2014	26.06.2017	24 327 379		-	100.104	26.06.	0.875	43.750	N
Bank of England (The Governor and company of the Bank of England), London, Grossbritannien												
	USD	1'000.00	14.03.2016	14.03.2019	31 861 189	%	99.140	99.833	14.03. 14.09.	1.250	6.298 6.043	N
Bank of Montreal, Montreal, Kanada												
Emissionsdisagio von 0.024% 11.12.2017 Em.preis: 99.976%	CAD	1'000.00	11.12.2012	11.12.2017	20 250 114		-	99.976	11.06. 11.12. 11.12.	2.240	8.053 8.656 0.18498	N
	USD	1'000.00	29.08.2016	28.08.2018	33 749 186	%	99.570	99.996	28.02. 28.08.	1.350	6.722 6.446	N
	USD	1'000.00	29.08.2016	27.08.2021	33 740 603	%	97.810	99.811	27.02. 27.08.	1.900	9.447 9.072	N
Bank of Nova Scotia (The), Toronto, Kanada	AUD	10'000.00	06.10.2017	06.10.2022	38 497 709	%	100.370	99.327		3.250	0.000	N
	CHF	5'000.00	16.09.2015	16.09.2022	29 565 357	%	101.650	100.104	16.09.	0.300	15.000	N
Bank of Queensland Limited, Brisbane, Australien												
	AUD	10'000.00	12.06.2014	12.06.2018	24 634 451	%	100.730	99.262	12.06. 12.12.	4.000	145.81 150.31	N
Bank of Scotland, Edinburgh, Grossbritannien	AUD	10'000.00	06.11.2014	06.11.2019	25 919 034	%	102.140	99.351	06.05. 06.11.	4.000	146.12 154.57	N
Emissionsdisagio von 0.07% 21.2.2017 Em.preis: 99.93%	USD	1'000.00	20.02.2007	21.02.2017	2 924 256		-	99.930	21.02. 21.02.	5.250	26.501 0.7067	N
Emissionsdisagio von 0.463% 8.6.2017 Em.preis: 99.537%	EUR	1'000.00	08.06.2007	08.06.2017	3 146 359		-	99.537	08.06. 08.06.	4.625	50.197 5.025	N
	EUR	50'000.00	04.06.2004	04.06.2019	1 872 563	%	107.400	99.780	04.06.	4.875	2'645.66	N
	GBP	1'000.00	16.08.1999	16.08.2019	853 282	%	107.870	98.754	16.08.	6.375	80.025	N
	EUR	50'000.00	08.02.2005	07.02.2020	2 061 943	%	108.660	99.025	07.02.	3.875	2'071.13	N
	EUR	1'000.00	13.07.2006	13.07.2021	2 626 234	%	115.700	98.986	13.07.	4.500	49.659	N
	EUR	1'000.00	08.06.2007	08.06.2022	3 145 298	%	119.990	99.600	08.06.	4.750	51.554	N
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd, Sydney, Australien												
	AUD	10'000.00	13.03.2015	13.03.2019	27 403 322	%	100.360	100.000	13.03.	VAR.	51.571	N
BANKIA S.A., Madrid, Spanien												
Emissionsdisagio von 1.076% 14.2.2017 Em.preis: 98.924%	EUR	100'000.00	14.02.2007	14.02.2017	2 926 366		-	98.924	14.02. 14.02.	4.375	4'671.92 1'145.88	N
	EUR	50'000.00	25.05.2006	25.05.2018	2 570 094	%	101.760	98.770	25.05.	4.250	2'316.56	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Banque Europeenne d'Investissement BEI, Luxemburg												
	USD	1'000.00	17.01.2007	17.01.2017	2 871 091		-	99.445	17.01. 17.01.	4.875	24.441 5.565	N
Emissionsdisagio von 0.555% 17.1.2017 Em.preis: 99.445%												
	AUD	1'000.00	23.01.2007	23.01.2017	2 874 262		-	99.521	23.01. 23.01.	6.125	23.373 3.626	N
Emissionsdisagio von 0.479% 23.1.2017 Em.preis: 99.521%												
	EUR	1'000.00	27.07.2009	27.01.2017	10 387 913		-	99.855	27.01.	VAR.	1.549	N
Emissionsdisagio von 0.145%												
	EUR	0.001	17.02.1997	17.02.2017	579 294		-	28.750		0.000	0.000	Y
	EUR	1'000.00	03.03.2010	03.03.2017	11 062 200		-	99.827	03.03. 03.03.	3.125	33.357 1.846	N
Emissionsdisagio von 0.173% 3.3.2017 Em.preis: 99.827%												
	SEK	10'000.00	04.11.2011	15.03.2017	14 185 625		-	100.906	15.03.	2.625	29.543	N
	CHF	5'000.00	21.04.2010	21.04.2017	11 074 108		-	100.698	21.04.	1.750	87.500	N
	NOK	10'000.00	14.02.2008	19.05.2017	3 793 028		-	94.996	19.05. 19.05.	4.250	49.482 58.261	N
Emissionsdisagio von 5.004% 19.5.2017 Em.preis: 94.996%												
	USD	1'000.00	30.05.2007	30.05.2017	3 127 334		-	99.783	30.05. 30.05.	5.125	24.992 2.116	N
Emissionsdisagio von 0.217% 30.5.2017 Em.preis: 99.783%												
	USD	1'000.00	03.04.2012	15.06.2017	18 308 249		-	99.936	15.06. 15.06.	1.625	0.62389 7.920	N
Emissionsdisagio von 0.064% 15.6.2017 Em.preis: 99.936%												
	JPY	100'000.00	30.06.2005	20.06.2017	2 197 767		-	99.781	20.06. 20.06.	1.400	6.099 1.913	N
Emissionsdisagio von 0.219% 20.6.2017 Em.preis: 99.781%												
	SEK	1'000'000.00	10.09.2007	12.08.2017	3 389 841		-	99.811	12.08. 12.08.	4.500	5'382.18 226.05	N
Emissionsdisagio von 0.189% 12.8.2017 Em.preis: 99.811%												
	GBP	1'000.00	14.02.1995	25.08.2017	339 011		-	99.832	25.08. 25.08.	8.750	107.99 2.073	N
Emissionsdisagio von 0.168% 25.8.2017 Em.preis: 99.832%												
	USD	1'000.00	26.07.2012	15.09.2017	19 102 844		-	99.420	15.03. 15.09. 15.09.	1.125	5.670 5.401 5.569	N
Emissionsdisagio von 0.58% 15.9.2017 Em.preis: 99.42%												
	ZAR	5'000.00	19.11.2013	15.09.2017	22 851 958		-	100.765	15.09.	6.750	24.632	N
	NOK	500'000.00	02.10.2008	02.10.2017	4 622 615		-	99.370	02.10. 02.10.	5.250	3'197.38 383.68	N
Emissionsdisagio von 0.63% 2.10.2017 Em.preis: 99.37%												
	EUR	1'000.00	03.07.2007	15.10.2017	3 230 038		-	99.871	15.10. 15.10.	4.750	54.646 1.484	N
Emissionsdisagio von 0.129% 15.10.2017 Em.preis: 99.871%												
	GBP	1'000.00	18.06.2009	07.12.2017	10 264 542		-	99.273	07.12. 07.12.	4.125	54.962 9.686	N
Emissionsdisagio von 0.727% 7.12.2017 Em.preis: 99.273%												
	NZD	2'000.00	27.03.2008	15.12.2017	11 638 604		-	99.914	15.06. 15.12. 15.12.	7.500	52.677 52.130 1.183	N
Emissionsdisagio von 0.08513% 15.12.2017 Em.preis: 99.91487%												
	NOK	10'000.00	17.01.2013	17.01.2018	20 436 557	%	99.930	101.300	17.01.	2.500	29.672	N
	EUR	2.00	16.02.1998	15.02.2018	839 817	%	100.160	100.085	15.02.	5.500	0.1176	N
	RUB	50'000.00	15.02.2013	15.02.2018	20 662 448	%	99.690	101.520	15.02.	6.000	52.926	N
	ZAR	5'000.00	12.03.2014	12.03.2018	23 835 610	%	100.050	100.573	12.03.	7.750	29.748	N
	EUR	1'000.00	16.06.2010	15.03.2018	11 426 175	%	100.640	99.282	15.03.	2.625	28.130	N
	TRY	1'000.00	30.01.2013	03.04.2018	20 484 075	%	98.050	101.212	03.04.	5.750	15.838	N
	CHF	5'000.00	30.04.2008	30.04.2018	3 916 526	%	101.340	100.590	30.04.	3.250	162.50	N
	AUD	1'000.00	30.05.2014	30.05.2018	24 514 766	%	100.460	99.629	30.05. 30.11.	3.250	11.719 12.213	N
	TRY	1'000.00	20.07.2011	20.07.2018	13 341 226	%	97.750	100.830	20.07.	9.250	24.982	N
	TRY	1'000.00	03.06.2013	03.09.2018	21 448 263	%	95.100	100.557	03.09.	5.250	14.632	N
	NZD	1'000.00	10.09.2014	10.09.2018	25 370 801	%	101.310	101.086	10.09.	4.250	29.356	N
	CAD	1'000.00	24.09.2013	24.09.2018	22 372 192	%	100.750	99.833	24.03. 24.09.	2.625	9.648 10.389	N
	GBP	1'000.00	14.01.2003	15.10.2018	1 536 132	%	103.310	99.323	15.10.	4.750	61.507	N
	NOK	10'000.00	31.10.2011	31.10.2018	14 110 187	%	102.540	101.032	31.10.	3.750	45.685	N
	ZAR	5'000.00	15.04.2008	21.12.2018	3 920 875	%	101.510	95.625	21.12.	9.000	35.019	N
	ZAR	5'000.00	30.04.1998	31.12.2018	885 500	%	93.340	8.700	31.12.	0.000	0.000	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	NZD	1'000.00	22.01.2014	22.01.2019	23 393 965	%	102.690	101.015	22.01.	4.750	34.358	N
	GBP	1'000.00	01.02.2013	01.02.2019	20 548 380	%	101.070	99.436	01.02.	1.500	18.875	N
	CHF	5'000.00	08.02.2007	08.02.2019	2 860 885	%	103.710	100.045	08.02.	2.500	125.00	N
	TRY	1'000.00	12.02.2010	12.03.2019	10 982 523	%	97.270	100.725	12.03. 12.09.	10.500	14.034 14.780	N
	SEK	10'000.00	15.01.2014	12.03.2019	23 337 940	%	102.960	99.619	12.03.	2.250	25.314	N
	USD	1'000.00	07.02.2012	15.03.2019	14 903 822	%	100.170	99.981	15.03. 15.09.	2.125	10.710 10.203	N
	AUD	1'000.00	29.11.2013	15.03.2019	22 938 899	%	102.510	99.684	15.03. 15.09.	4.250	16.131 16.466	N
	EUR	1'000.00	11.02.2009	15.04.2019	2 284 848	%	106.050	99.569	15.04.	4.250	45.396	N
	SEK	10'000.00	23.04.2012	23.04.2019	18 382 771	%	104.210	99.379	23.04.	3.000	33.726	N
	NOK	10'000.00	05.09.2012	22.05.2019	19 381 166	%	102.610	101.566	22.05.	3.000	34.996	N
	RUB	50'000.00	16.07.2012	16.07.2019	19 077 251	%	102.160	99.175	16.07.	7.500	60.896	N
	TRY	1'000.00	22.11.2013	25.07.2019	22 872 831	%	94.400	101.600	25.07.	8.500	22.634	N
	CHF	5'000.00	02.02.2012	02.08.2019	14 669 842	%	103.200	100.615	02.08.	1.250	62.500	N
	EUR	1'000.00	16.09.2010	16.09.2019	11 748 138	%	105.140	99.388	16.09.	2.500	28.698	N
	ZAR	5'000.00	26.10.2012	21.10.2019	19 869 149	%	97.910	100.219	21.10.	6.000	21.544	N
	BRL	5'000.00	22.10.2009	22.10.2019	10 667 605	%	88.220	38.375		0.000	0.000	Y
	EUR	1'000.00	18.07.2013	15.11.2019	21 882 843	%	103.470	99.798	15.11.	1.375	16.059	N
	TRY	1'000.00	09.04.2014	15.11.2019	24 114 433	%	97.390	101.405	15.11.	10.750	27.360	N
	CHF	5'000.00	22.03.2010	22.01.2020	11 034 622	%	106.150	100.388	22.01.	2.125	106.25	N
	NOK	10'000.00	04.02.2013	04.02.2020	20 557 964	%	103.870	101.190	04.02.	3.000	36.168	N
	MXN	1'000.00	25.02.2015	25.02.2020	27 138 630	%	92.500	100.960	25.02.	4.000	2.037	N
	GBP	1'000.00	08.04.2014	07.03.2020	24 042 363	%	103.280	99.601	07.03.	2.250	27.808	N
	TRY	1'000.00	25.11.2014	01.04.2020	26 089 313	%	90.980	99.757	01.04.	8.000	22.036	N
	EUR	1'000.00	15.07.2004	15.04.2020	1 902 263	%	111.650	98.958	15.04.	4.625	49.401	N
	AUD	1'000.00	30.04.2015	30.04.2020	28 013 349	%	100.710	99.290	30.04. 30.10.	2.500	9.334 9.594	N
	NOK	10'000.00	27.02.2015	15.05.2020	27 228 219	%	100.580	101.175	15.05.	1.125	13.126	N
	EUR	1'000.00	08.06.2005	08.06.2020	2 158 108	%	101.000	100.000	08.06.	VAR.	5.318	N
	TRY	1'000.00	18.08.2014	06.07.2020	25 146 371	%	92.960	101.513	06.07.	8.750	23.219	N
	CHF	5'000.00	11.07.2005	10.07.2020	2 180 394	%	107.650	100.850	10.07.	2.375	118.75	N
	NZD	1'000.00	30.07.2014	30.07.2020	24 966 723	%	107.500	101.006	30.07.	4.625	33.457	N
	AUD	1'000.00	06.08.2010	06.08.2020	11 569 344	%	108.530	98.471	06.02. 06.08.	6.000	22.937 22.877	N
	ZAR	5'000.00	10.09.2014	10.09.2020	25 333 634	%	100.700	101.016	10.09.	7.500	27.594	N
	TRY	1'000.00	07.05.2015	07.10.2020	28 014 094	%	93.350	101.040	07.10.	9.125	23.932	N
	SEK	5'000.00	13.05.2005	01.12.2020	2 155 337	%	114.230	115.685	01.12.	5.000	29.389	N
	AUD	1'000.00	15.01.2016	15.01.2021	31 020 479	%	101.220	99.676	15.01. 15.07.	2.800	10.667 10.452	N
	AUD	1'000.00	10.03.2006	10.03.2021	2 485 152	%	91.640	44.672		0.000	0.000	Y
	ZAR	10'000.00	18.03.2011	31.03.2021	12 697 874	%	104.170	100.375	31.03.	9.000	67.183	N
	CHF	5'000.00	14.04.2009	14.04.2021	10 012 835	%	111.650	101.450	14.04.	3.000	150.00	N
	NOK	10'000.00	14.04.2016	25.05.2021	32 193 839	%	99.640	101.189	25.05.	1.000	11.659	N
	GBP	1'000.00	12.10.1998	07.06.2021	959 906	%	114.200	99.722	07.06.	5.375	67.134	N
	ZAR	5'000.00	13.06.2014	13.09.2021	24 523 927	%	102.020	101.073	13.09.	8.250	30.194	N
	TRY	1'000.00	18.06.2014	18.09.2021	24 611 114	%	91.740	99.818	18.09.	8.750	24.122	N
	NOK	10'000.00	12.05.2015	12.05.2022	28 072 167	%	100.910	100.371	12.05.	1.500	17.523	N
	ZAR	5'000.00	29.07.2014	29.07.2022	24 967 720	%	102.380	101.600	29.07.	8.375	30.623	N
	CHF	5'000.00	24.08.2010	24.08.2022	11 559 548	%	111.950	101.068	24.08.	2.000	100.00	N
reine Differenzbesteuerung	TRY	1'000.00	05.09.2007	05.09.2022	3 359 761	%	61.350	22.325		0.000	0.000	Y
	EUR	1'000.00	28.09.2010	28.09.2022	11 788 292	%	114.840	99.662	28.09.	3.000	34.345	N
	EUR	1'000.00	25.09.2012	14.10.2022	19 597 509	%	111.510	98.919	15.10.	2.250	25.885	N
	GBP	100.00	31.10.2012	31.10.2022	19 886 771	%	106.790	99.378	31.10.	2.500	3.309	N
	CHF	5'000.00	26.10.2012	26.04.2023	19 687 866	%	108.400	100.756	26.04.	1.125	56.250	N
	EUR	1'000.00	14.09.2016	16.10.2023	33 902 333	%	99.460	101.703	16.10.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	23.11.2011	23.11.2023	14 205 439	%	111.950	100.372	23.11.	1.625	81.250	N
	NOK	10'000.00	26.01.2017	26.01.2024	35 441 128	%	99.790	99.885		1.500	0.000	N
	EUR	1'000.00	07.03.2007	15.04.2024	2 967 468	%	125.370	98.933	15.04.	4.125	44.061	N
	CHF	5'000.00	02.08.2012	02.08.2024	18 892 745	%	111.350	101.264	02.08.	1.500	75.000	N
	ZAR	10'000.00	17.09.2014	17.09.2024	25 439 249	%	101.810	98.375	17.09.	8.500	61.427	N
	TRY	1'000.00	03.10.2014	03.10.2024	25 545 763	%	93.090	98.740	03.10.	9.250	25.193	N
	CHF	5'000.00	04.02.2014	04.02.2025	23 300 417	%	112.750	100.338	04.02.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	11.02.2010	11.02.2025	10 713 468	%	120.150	100.278	11.02.	2.625	131.25	N
	GBP	1'000.00	18.04.2000	15.04.2025	1 073 202	%	129.310	99.544	15.04.	5.500	69.380	N
	EUR	1'000.00	07.05.2009	15.10.2025	10 161 223	%	132.570	99.636	15.10.	4.500	51.770	N
	CHF	5'000.00	02.04.2012	02.04.2026	18 000 611	%	114.300	100.380	02.04.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	15.10.2007	15.10.2027	3 359 647	%	132.450	100.985	15.10.	3.375	168.75	N
	CHF	5'000.00	21.02.2013	21.02.2028	20 497 542	%	113.250	100.012	21.02.	1.375	68.750	N
	GBP	1'000.00	25.03.1998	07.12.2028	870 038	%	143.860	100.000	07.12.	6.000	79.945	N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	GBP	1'000.00	18.07.2000	07.06.2032	1 102 402	%	149.020	99.115	07.06.	5.625	70.256	N
	CHF	5'000.00	28.06.2013	28.06.2033	21 537 632	%	122.000	100.532	28.06.	1.750	87.500	N
	USD	1'000.00	02.03.2006	15.02.2036	2 464 324	%	130.420	99.177	15.02. 15.08.	4.875	24.580 23.713	N
	CHF	5'000.00	30.06.2006	30.06.2036	2 589 694	%	147.950	101.090	30.06.	3.125	156.25	N
	EUR	1'000.00	18.05.2005	15.10.2037	2 156 952	%	151.370	99.214	15.10.	4.000	46.018	N
	GBP	1'000.00	27.04.1999	15.04.2039	659 047	%	153.000	99.741	15.04.	5.000	63.073	N
Banque Federative du Credit Mutuel, Strasbourg, Frankreich												
	EUR	1'000.00	27.04.2007	27.04.2017	3 064 556		-	99.686	27.04. 27.04.	4.625	49.989 3.393	N
Emissionsdisagio von 0.314% 27.4.2017 Em.preis: 99.686%												
	CHF	5'000.00	12.02.2014	12.02.2019	23 372 066	%	101.770	100.585	12.02.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	22.05.2014	22.05.2020	24 306 925	%	103.250	100.169	22.05.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	11.04.2013	11.04.2023	20 967 521	%	107.650	100.426	11.04.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	08.12.2015	08.12.2023	30 392 565	%	102.000	100.215	08.12.	0.550	27.500	N
	CHF	5'000.00	22.05.2014	22.05.2024	24 306 928	%	111.250	101.218	22.05.	2.000	100.00	N
	CHF	1'000.00	10.02.2017	10.02.2025	35 513 985	%	100.700	100.000		0.320	0.000	N
	CHF	5'000.00	19.06.2017	19.12.2025	36 882 547	%	100.650	100.000	19.12.	0.400	10.000	N
	CHF	5'000.00	05.10.2017	05.04.2027	37 961 097	%	100.950	100.891		0.600	0.000	N
Banque Internationale a Luxembourg S.A., Luxemburg												
	CHF	5'000.00	11.04.2016	11.10.2022	31 559 391	%	101.250	100.264	11.10.	0.550	27.500	N
Banque PSA Finance, Paris, Frankreich												
	USD	1'000.00	04.04.2011	04.04.2021	12 786 373	%	108.210	99.520	04.04. 04.10.	5.750	28.794 28.008	N
Barclays Bank PLC, London, Grossbritannien												
Regd.Notes 2002-Without Fixed Maturity Variable Rate Reg-S	USD	1'000.00	25.09.2002		1 490 140	%	120.700	100.000	15.06. 15.12.	6.860	33.437 34.020	N
Notes 2002-Without fixed maturity core tier one Sub-144A- Fltg Rt	USD	1'000.00	25.09.2002		1 490 474	%	114.050	100.000	15.06. 15.12.	6.860	33.437 34.020	N
Regd.Notes 2008-Without Fixed Maturity VRN Subord.	GBP	1'000.00	27.11.2008		4 847 693	%	118.000	100.000	15.06.	14.000	174.16	N
	EUR	1'000.00	20.01.2010	20.01.2017	10 917 404		-	99.563	20.01. 20.01.	4.000	43.057 4.691	N
Emissionsdisagio von 0.437% 20.1.2017 Em.preis: 99.563%												
	EUR	1'000.00	10.02.2012	10.02.2017	11 862 574		-	100.000	10.02.	VAR.	7.775	N
	GBP	1'000.00	17.08.2009	17.08.2021	10 452 112	%	116.510	99.583	17.08.	5.750	71.446	N
Barclays PLC, London, Grossbritannien												
Notes 2013-without fixed maturity Subord Conv Fltg Rt	USD	1'000.00	20.11.2013		22 881 699	%	104.120	99.993	15.03. 15.06. 15.09. 15.12.	8.250	20.791 20.106 19.806 20.456	N
Regd.Contingent Convertible Securities 2013-Without Fixed Maturity Conv.Variable Rate Subord.	EUR	1'000.00	10.12.2013		23 054 187	%	114.970	100.000	15.03. 15.06. 15.09. 15.12.	8.000	21.433 21.739 22.977 23.339	N
(no min.) Regd.Notes 2014-Without Fixed Maturity Floating Rate Subord.	EUR	1'000.00	16.06.2014		24 485 505	%	106.690	100.000	15.03. 15.06. 15.09. 15.12.	VAR.	17.414 17.662 18.668 18.962	N
Contingent Convertible Notes 2014-Without Fixed Maturity Conv. Variable Rate	GBP	1'000.00	17.06.2014		24 485 495	%	104.990	100.000	15.03. 15.06. 15.09. 15.12.	7.000	21.266 21.949 23.032 23.052	N
AT1 Securities 2014-without fixed maturity	USD	1'000.00	17.06.2014		24 495 639	%	102.660	100.000	15.03. 15.06. 15.09. 15.12.	6.625	16.696 16.145 15.904 16.427	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Subordinated Contingent Convertible Securities 2015-Without Fixed Maturity Conv.Variable Rate Reg-S	GBP	1'000.00	11.08.2015		29 169 051	%	111.330	99.990	15.03.	7.875	23.925	N
									15.06.		24.692	
									15.09.		25.912	
									15.12.		25.933	
Notes 2016-open end Global Variable Rate	USD	1'000.00	31.08.2016		33 747 258	%	109.790	99.996	15.03.	7.875	19.846	N
									15.06.		19.192	
									15.09.		18.905	
									15.12.		19.526	
Bonds 2017-Without Fixed Maturity Fixed/ Floating Rate	GBP	1'000.00	07.03.2017		35 912 505	%	109.040	99.998	15.06.	7.250	24.709	N
									15.09.		23.855	
									15.12.		23.875	
Contingent Convertible Bonds 2017-Without Fixed Maturity Fixed/Floating Rate	GBP	1'000.00	10.08.2017		37 807 987	%	99.000	100.000	15.12.	5.875	27.001	N
	USD	1'000.00	12.01.2016	12.01.2021	30 992 988	%	100.830	99.945	12.01.	3.250	16.381	N
									12.07.		15.667	
	EUR	1'000.00	23.03.2016	23.03.2021	31 965 989	%	104.660	99.684	23.03.	1.875	20.072	N
	GBP	1'000.00	12.08.2016	12.02.2027	33 579 081	%	104.420	99.924	12.02.	3.250	20.587	N
Barrick Gold Corporation, Toronto, Kanada												
	USD	1'000.00	03.04.2012	01.04.2022	18 598 205	%	104.440	99.943	01.04.	3.850	19.308	N
									01.10.		18.739	
	USD	1'000.00	02.05.2013	01.05.2023	22 083 262		-	99.797	01.05.	4.100	20.376	N
									21.09.		15.514	
Emissionsdisagio von 0.203%									21.09.		1.975	
Rückzahlungsagio von 9.9132735%									21.09.		96.459	
21.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Barrick North America Finance LLC, Salt Lake City, USA												
	USD	1'000.00	01.06.2011	30.05.2021	13 802 594	%	105.060	99.936	30.05.	4.400	21.456	N
									30.11.		21.603	
Barry Callebaut Services NV, Lebbeke, Belgien												
	EUR	1'000.00	13.07.2007	13.07.2017	3 249 533		-	99.005	13.07.	6.000	66.213	N
Emissionsdisagio von 0.995%									13.07.		10.980	
13.7.2017 Em.preis: 99.005%												
	EUR	1'000.00	15.06.2011	15.06.2021	13 175 819	%	117.370	99.260	15.06.	5.625	61.140	N
	EUR	100'000.00	24.05.2016	24.05.2024	32 621 099	%	106.500	99.104	24.05.	2.375	2'594.33	N
BASF SE, Ludwigshafen am Rhein, Deutschland												
	GBP	50'000.00	31.03.2009	31.03.2017	10 064 740		-	99.304	31.03.	5.875	3'676.76	N
Emissionsdisagio von 0.696%									31.03.		435.57	
31.3.2017 Em.preis: 99.304%												
	EUR	1'000.00	07.07.2009	07.07.2017	10 317 035		-	99.928	07.07.	4.625	50.812	N
Emissionsdisagio von 0.072%									07.07.		0.79102	
7.7.2017 Em.preis: 99.928%												
	EUR	1'000.00	01.10.2012	01.10.2018	19 655 219	%	101.310	99.489	01.10.	1.500	17.136	N
	EUR	1'000.00	22.01.2014	22.01.2019	23 390 474	%	101.290	99.870	22.01.	1.375	14.797	N
	EUR	1'000.00	04.02.2013	04.02.2021	20 577 064	%	105.900	99.062	04.02.	1.875	20.044	N
	EUR	1'000.00	22.01.2014	22.01.2024	23 390 756	%	111.940	99.424	22.01.	2.500	26.904	N
BAT International Finance PLC, London, Grossbritannien												
	EUR	1'000.00	29.06.2007	29.06.2017	3 215 665		-	99.528	25.02.	5.375	57.518	N
									29.06.		19.964	
Emissionsdisagio von 0.472%									29.06.		5.160	
29.6.2017 Em.preis: 99.528%												
	GBP	1'000.00	12.12.2003	12.12.2019	1 740 206	%	110.040	99.136	12.12.	6.375	84.294	N
	EUR	1'000.00	07.07.2010	07.07.2020	11 482 037	%	109.670	99.434	07.07.	4.000	43.946	N
	CHF	5'000.00	05.09.2014	08.09.2021	25 351 475	%	102.200	100.199	08.09.	0.625	31.250	N
	EUR	1'000.00	09.11.2011	09.11.2021	14 257 587	%	112.240	99.202	09.11.	3.625	42.066	N
	USD	1'000.00	07.06.2012	07.06.2022	18 750 573	%	101.400	99.064	07.06.	3.250	15.661	N
									07.12.		16.136	
	GBP	50'000.00	29.06.2009	29.06.2022	10 293 737	%	118.850	98.946	29.06.	6.000	3'730.93	N
	EUR	1'000.00	19.11.2012	19.01.2023	20 027 766	%	108.440	99.362	19.01.	2.375	25.540	N
	EUR	1'000.00	25.03.2013	25.03.2025	21 005 768	%	111.050	99.748	25.03.	2.750	29.434	N
	CHF	5'000.00	05.09.2014	08.09.2026	25 351 476	%	106.450	100.916	08.09.	1.375	68.750	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
BAWAG P.S.K. Bank fuer Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG, Wien, Österreich												
	CHF	5'000.00	02.11.2016	02.11.2018	34 091 217	%	100.250	100.500	02.02.	VAR.	0.000	N
									02.05.		0.000	
									02.08.		0.000	
									02.11.		0.000	
	CHF	5'000.00	26.10.2016	15.09.2021	33 833 049	%	99.850	100.000	15.09.	0.010	0.44305	N
Bayer AG, Leverkusen, Deutschland												
	GBP	50'000.00	23.05.2006	23.05.2018	2 571 243	%	101.860	99.056	23.05.	5.625	3'546.87	N
	EUR	1'000.00	02.04.2015	02.04.2075	27 754 971	%	103.330	99.499	02.10.	2.375	27.133	N
	EUR	1'000.00	01.07.2014	01.07.2075	24 795 240	%	104.390	100.000	01.07.	3.000	32.845	N
Bayerische Landesbank, Muenchen, Deutschland												
	EUR	50'000.00	23.10.2007	23.10.2017	3 490 081		-	99.473	23.10.	5.750	3'328.81	N
Emissionsdisagio von 0.527% 23.10.2017 Em.preis: 99.473%									23.10.		305.09	
	CHF	5'000.00	27.06.2007	27.06.2018	3 128 087	%	101.870	100.480	27.06.	3.125	156.25	N
	EUR	50'000.00	15.05.2007	31.12.2019	3 099 408	%	112.000	99.010	28.04.	5.125	2'777.75	N
	EUR	1'000.00	15.03.2013	15.12.2021	20 135 754	%	106.050	99.880	15.12.	1.700	19.838	N
BBVA Banco Continental, Lima, Peru												
	USD	1'000.00	29.08.2012	26.08.2022	19 356 130	%	107.650	100.000	26.02.	5.000	25.140	N
									26.08.		23.876	
BBVA International Preferred, SA, Bilbao, Spanien												
Non-Cumulative Perpetual Guaranteed Preferred Securities 2007-Without Fixed Maturity VRN Junior Reg-S Srs D Subord.	GBP	1'000.00	19.07.2007		3 222 569	%	62.010	100.000	19.01.	VAR.	4.014	N
									19.04.		3.878	
									19.07.		3.760	
									19.10.		3.772	
Non-Cumulative Perpetual Guaranteed Preferred Securities 2005-Without Fixed Maturity VRN Junior Reg-S Srs A Subord. 22.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	22.09.2005	03.04.2017	2 276 721		-	100.000	22.03.	VAR.	3.573	N
Belfius Bank SA/NV, Brussel, Belgien												
	EUR	100'000.00	27.11.2012	27.11.2017	20 076 537		-	99.678	27.11.	1.250	1'461.37	N
Emissionsdisagio von 0.322% 27.11.2017 Em.preis: 99.678%									27.11.		376.45	
	EUR	100'000.00	05.06.2013	05.06.2020	21 523 198	%	103.850	99.801	05.06.	1.375	1'492.42	N
	EUR	100'000.00	30.01.2013	30.01.2023	20 514 024	%	110.060	99.688	30.01.	2.125	2'271.56	N
	EUR	100'000.00	14.09.2016	14.09.2026	33 890 030	%	95.170	99.446	14.09.	0.125	143.49	N
Belgique, Belgien												
	EUR	0.010	23.01.2007	28.03.2017	2 881 401		-	99.177	28.03.	4.000	0.00042	N
Emissionsdisagio von 0.823% 28.3.2017 Em.preis: 99.177%									28.03.		0.00008	
	EUR	0.010	05.06.2002	28.09.2017	1 431 531		-	99.434	28.09.	5.500	0.00062	N
Emissionsdisagio von 0.566% 28.9.2017 Em.preis: 99.434%									28.09.		0.00006	
	EUR	0.010	29.01.2008	28.03.2018	3 720 072	%	101.130	98.030	28.03.	4.000	0.00042	N
	EUR	0.010	26.02.2013	22.06.2018	20 761 007	%	100.940	99.762	22.06.	1.250	0.00013	N
	EUR	0.010	19.01.2010	28.09.2020	10 913 670	%	111.580	99.032	28.09.	3.750	0.00042	N
	EUR	0.010	25.01.2011	28.09.2021	12 357 506	%	117.240	98.971	28.09.	4.250	0.00048	N
	EUR	0.010	24.05.2006	28.03.2022	2 565 098		n.v.	97.315	28.03.	4.000	0.00042	N
	EUR	0.010	24.01.2012	28.09.2022	14 789 038	%	120.960	99.581	28.09.	4.250	0.00048	N
	EUR	0.010	16.01.2013	22.06.2023	20 436 130	%	112.560	99.009	22.06.	2.250	0.00024	N
	EUR	200.00	21.01.2014	22.06.2024	23 393 991	%	115.880	99.657	22.06.	2.600	0.00028	N
	EUR	0.010	14.01.2015	22.06.2025	26 626 363	%	103.450	99.177	22.06.	0.800	0.00008	N
	EUR	0.010	14.06.2011	28.03.2026	13 168 599	%	133.870	99.751	28.03.	4.500	0.00048	N
	EUR	0.010	28.03.1997	28.03.2028	856 518	%	148.790	98.929	28.03.	5.500	0.00058	N
	EUR	0.010	19.05.2004	28.03.2035	1 862 011	%	160.620	98.842	28.03.	5.000	0.00053	N
Bendigo and Adelaide Bank Ltd, Bendigo, Australien												
	CHF	5'000.00	25.03.2014	25.03.2019	23 448 740	%	101.590	100.415	25.03.	1.125	56.250	N
Berlin Hyp AG, Berlin, Deutschland												
	EUR	1'000.00	28.03.2007	28.03.2017	3 014 142		-	99.725	28.03.	4.125	44.092	N
Emissionsdisagio von 0.275% 28.3.2017 Em.preis: 99.725%									28.03.		2.939	
	EUR	1'000.00	04.05.2007	03.05.2019	3 085 037	%	106.500	100.006	03.05.	4.500	48.654	N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Bertelsmann SE & Co. KGaA, Guetersloh, Deutschland												
15 % Genusssch. 2000-ohne festen Verfall nachrangig	EUR	10.00	01.07.2000		1 176 752	%	334.000	100.000	15.05.	15.000	1.645	N
BG Energy Capital PLC, Reading, Grossbritannien	EUR	100'000.00	02.08.2012	02.08.2022	19 150 879	%	110.340	98.954	02.08.	2.625	3'010.74	N
Emissionsdisagio von 0.08% 7.12.2017 Em.preis: 99.92%	GBP	1'000.00	02.06.2009	07.12.2017	10 220 223		-	99.920	07.12. 07.12.	5.125	68.286 1.065	N
	EUR	1'000.00	16.11.2011	16.11.2018	14 304 676	%	102.700	99.950	16.11.	3.000	35.080	N
	EUR	1'000.00	16.07.2010	16.07.2019	11 526 298	%	105.620	99.510	16.07.	3.625	40.043	N
30.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	27.06.2012	30.11.2072	18 879 121		-	100.000	30.05. 30.11.	6.500	31.697 31.913	N
Bharat Petroleum Corp Ltd, Mumbai, Indien												
	CHF	5'000.00	20.03.2014	20.12.2019	23 448 739	%	104.900	100.523	20.12.	3.000	150.00	N
Bharti Airtel International Netherlands B.V., Amsterdam, Niederlande												
	CHF	5'000.00	31.03.2014	31.03.2020	23 448 742	%	106.000	100.508	31.03.	3.000	150.00	N
BHP Billiton Finance Ltd, Melbourne, Australien												
Emissionsdisagio von 0.944% 18.10.2017 Em.preis: 99.056%	AUD	10'000.00	18.10.2012	18.10.2017	19 782 728		-	99.056	18.04. 18.10. 18.10.	3.750	140.82 144.63 72.622	N
22.8.2017 Rückkauf ausstehender Titel	EUR	1'000.00	29.05.2012	29.11.2018	18 677 831	%	101.950	99.867	29.11.	2.125	24.783	N
22.8.2017 Rückkauf ausstehender Titel	EUR	1'000.00	25.09.2012	25.09.2020	19 615 836	%	106.060	99.761	25.09.	2.250	25.878	N
BHP Billiton Finance (USA) Ltd, Melbourne, Australien	EUR	1'000.00	25.09.2012	24.09.2027	19 616 559	%	119.530	98.560	24.09.	3.250	37.379	N
Emissionsdisagio von 0.272% 24.2.2017 Em.preis: 99.728%	USD	1'000.00	24.02.2012	24.02.2017	18 050 731		-	99.728	24.02. 24.02.	1.625	8.179 2.738	N
	USD	1'000.00	25.03.2009	01.04.2019	10 055 387	%	105.270	99.679	01.04. 01.10.	6.500	32.599 31.637	N
22.2.2017 Rückkauf ausstehender Titel 21.8.2017 Rückkauf ausstehender Titel	USD	1'000.00	21.11.2011	21.11.2021	14 345 148	%	102.630	99.097	21.05. 21.11.	3.250	15.806 16.125	N
22.2.2017 Rückkauf ausstehender Titel 21.8.2017 Rückkauf ausstehender Titel	USD	1'000.00	24.02.2012	24.02.2022	18 050 718	%	100.840	99.064	24.02. 24.08.	2.875	14.470 13.865	N
Bilfinger SE, Mannheim, Deutschland												
	EUR	1'000.00	07.12.2012	07.12.2019	20 144 924	%	103.390	99.892	07.12.	2.375	27.806	N
Black Sea Trade & Development Bank, Griechenland												
	CHF	5'000.00	27.05.2015	20.12.2019	28 186 449	%	103.000	100.473	20.12.	1.625	81.250	N
Blackstone Holdings Finance Co LLC, New York, USA												
	USD	1'000.00	20.09.2010	15.03.2021	11 764 853	%	109.410	99.515	15.03. 15.09.	5.875	29.612 28.208	N
BMW Australia Finance Ltd, Australien												
	AUD	10'000.00	23.02.2015	23.02.2018	27 128 870	%	100.050	99.494	23.02. 23.08.	2.750	107.70 103.90	N
BMW Finance NV, Rijswijk, Niederlande												
Emissionsdisagio von 0.75% 18.1.2017 Em.preis: 99.25%	EUR	1'000.00	18.01.2010	18.01.2017	10 909 808		-	99.250	18.01. 18.01.	3.875	41.616 8.032	N
	DEM	1'000.00	01.04.1987	21.04.2017	534 664		-	100.000	21.04.	VAR.	0.000	N
	CHF	5'000.00	29.09.2011	29.09.2017	13 877 305		-	100.221	29.09.	1.750	87.500	N
Emissionsdisagio von 0.614% 2.10.2017 Em.preis: 99.386%	GBP	1'000.00	02.10.2009	02.10.2017	10 608 898		-	99.386	02.10. 02.10.	5.000	64.610 7.934	N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	AUD	2'000.00	22.11.2013	22.11.2017	22 881 705		-	99.856	22.11.	4.250	63.402	N
Emissionsdisagio von 0.144% 22.11.2017 Em.preis: 99.856%									22.11.		2.148	
	EUR	1'000.00	29.07.2011	29.01.2018	13 435 862	%	100.300	99.731	29.01.	3.625	38.750	N
	EUR	1'000.00	05.12.2012	05.06.2018	20 120 597	%	100.650	99.825	05.06.	1.500	16.281	N
	AUD	2'000.00	23.01.2014	23.07.2018	23 387 190	%	100.880	99.923	23.07.	4.375	65.670	N
	EUR	1'000.00	06.08.2003	06.08.2018	1 647 778	%	103.040	99.200	06.08.	5.000	57.350	N
	EUR	1'000.00	05.09.2014	05.09.2018	25 318 924	%	100.580	99.449	05.09.	0.500	5.698	N
	GBP	1'000.00	02.02.2012	14.12.2018	14 857 937	%	102.450	99.872	14.12.	3.375	44.857	N
	EUR	1'000.00	13.01.2012	14.01.2019	14 676 641	%	103.590	99.698	14.01.	3.250	34.940	N
	NOK	10'000.00	25.04.2014	25.04.2019	24 262 207	%	102.430	99.885	25.04.	2.750	31.939	N
	EUR	1'000.00	17.01.2014	17.07.2019	23 320 405	%	102.830	99.323	17.07.	1.625	17.950	N
	AUD	2'000.00	24.08.2016	24.08.2020	33 674 388	%	99.930	99.721	24.08.	2.500	38.118	N
	EUR	1'000.00	04.09.2013	04.09.2020	22 234 160	%	105.350	99.465	04.09.	2.000	22.779	N
	EUR	1'000.00	17.11.2015	17.11.2020	30 413 439	%	102.470	99.937	17.11.	0.875	10.216	N
	NOK	10'000.00	18.07.2017	18.01.2021	37 478 243	%	100.650	99.918		1.500	0.000	N
	EUR	1'000.00	05.09.2014	05.09.2022	25 317 716	%	104.320	99.630	05.09.	1.250	14.246	N
	EUR	1'000.00	24.01.2013	24.01.2023	20 476 634	%	110.220	99.132	24.01.	2.375	25.588	N
	EUR	1'000.00	17.01.2014	17.01.2024	23 320 414	%	112.730	99.238	17.01.	2.625	28.223	N
	EUR	1'000.00	21.01.2015	21.01.2025	26 657 498	%	102.460	99.208	21.01.	1.000	10.761	N
BMW US Capital LLC, Woodcliff Lake, USA												
	NZD	2'000.00	08.12.2014	08.12.2017	26 275 371		-	99.689	08.12.	4.375	59.568	N
Emissionsdisagio von 0.311% 8.12.2017 Em.preis: 99.689%									08.12.		4.234	
	GBP	1'000.00	20.11.2014	20.11.2019	26 106 660	%	101.800	99.436	20.11.	2.000	26.287	N
Tranche 942 Reg S	AUD	2'000.00	02.06.2016	02.12.2019	32 705 813	%	100.560	101.221	02.12.	2.750	41.138	N
	EUR	1'000.00	18.09.2015	18.09.2021	29 667 088	%	103.340	99.689	18.09.	1.125	12.914	N
	EUR	1'000.00	20.04.2015	20.04.2022	27 849 386	%	101.420	99.483	20.04.	0.625	6.695	N
BNP Paribas / BNP Paribas US Medium Term Note Program LLC, Paris, Frankreich												
Tranche 893	USD	1'000.00	14.09.2012	14.09.2017	19 482 903		-	99.869	14.03.	2.375	11.967	N
									14.09.		11.481	
Emissionsdisagio von 0.131% 14.9.2017 Em.preis: 99.869%									14.09.		1.266	
BNP Paribas Fortis NV, Brüssel, Belgien												
	EUR	1'000.00	01.02.2007	01.02.2017	2 895 012		-	99.801	01.02.	4.375	46.837	N
Emissionsdisagio von 0.199% 1.2.2017 Em.preis: 99.801%									01.02.		2.124	
BNP PARIBAS HOME LOAN SFH, Paris, Frankreich												
	EUR	50'000.00	12.01.2010	12.01.2017	10 887 727		-	99.400	12.01.	3.375	1'817.25	N
Emissionsdisagio von 0.6% 12.1.2017 Em.preis: 99.4%									12.01.		322.18	
	EUR	50'000.00	20.04.2010	20.04.2020	11 223 216	%	109.380	99.975	20.04.	3.750	2'008.68	N
	CHF	5'000.00	07.02.2011	07.10.2020	12 295 167	%	107.250	101.047	07.10.	2.375	118.75	N
	EUR	100'000.00	11.01.2011	11.01.2021	12 262 549	%	112.020	99.102	11.01.	3.750	4'029.32	N
BNP Paribas Issuance B.V., Amsterdam, Niederlande												
Open End Zertifikat auf AUD-Total Return Money Market Index	CHF	100.00	25.05.2005		2 161 437	CHF	128.800	100.000		0.000	0.000	Y
Open End Zertifikat auf NZD-Total Return Money Market Index	CHF	100.00	01.06.2005		2 169 507	CHF	126.900	100.000		0.000	0.000	Y
BNP Paribas Public Sector SCF, Paris, Frankreich												
	EUR	1'000.00	26.02.2010	26.02.2020	11 051 806	%	108.790	99.207	26.02.	3.750	40.129	N
BNP Paribas SA, Paris, Frankreich												
4 7/8 % Notes 2005-Perpetuelle	EUR	1'000.00	17.10.2005		2 301 809	%	103.830	100.000	17.10.	4.875	56.147	N
6 1/4 % Notes 2005-Perpetuelle	USD	2'000.00	17.10.2005		2 298 955	%	104.090	100.000	17.10.	6.250	122.50	N
6 1/2 % Notes 2007-Perpetuelle	USD	2'000.00	06.06.2007		3 115 593	%	102.780	100.000	06.03.	6.500	32.866	N
									06.06.		31.317	
									06.09.		30.997	
									06.12.		32.167	
	EUR	1'000.00	07.09.2007	07.09.2017	3 390 040		-	100.000	07.09.	5.431	62.127	N
	CHF	10'000.00	29.10.2012	04.01.2018	19 873 916	%	101.330	100.000	04.01.	2.850	285.00	N
	EUR	1'000.00	21.05.2013	21.11.2018	21 423 500	%	101.430	99.363	21.11.	1.375	15.998	N
	NOK	10'000.00	24.03.2014	24.06.2019	23 618 504	%	102.780	100.493	24.06.	3.125	35.763	N
	AUD	2'000.00	19.09.2013	19.09.2019	22 293 653	%	104.450	100.624	19.09.	5.250	80.881	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	USD	1'000.00	03.10.2014	03.10.2019	24 782 645	%	98.750	100.000	03.01. 03.04. 03.07. 03.10.	VAR.	4.115 4.012 3.852 3.895	N
	NZD	2'000.00	04.12.2013	04.12.2019	22 931 817	%	105.710	99.434	04.12.	5.875	79.251	N
	NZD	2'000.00	17.01.2014	17.01.2020	23 320 926	%	106.280	99.470	17.01.	6.000	86.720	N
	NZD	2'000.00	26.02.2015	26.02.2020	27 200 445	%	103.300	99.845	26.02.	4.500	65.495	N
	AUD	2'000.00	05.03.2014	05.03.2021	23 792 345	%	106.290	99.655	05.03.	5.125	78.658	N
	CHF	5'000.00	12.09.2012	12.09.2022	19 304 060	%	108.450	100.287	12.09.	1.875	93.750	N
	NOK	10'000.00	21.06.2017	21.12.2022	37 164 879	%	99.740	99.682	21.12.	2.125	12.574	N
	EUR	1'000.00	15.01.2016	15.01.2023	31 056 904	%	102.570	99.586	15.01.	1.125	12.094	N
	EUR	1'000.00	17.02.2015	17.02.2025	27 128 194	%	107.040	99.640	17.02.	2.375	25.340	N
	CHF	5'000.00	05.06.2015	05.06.2025	28 234 433	%	105.700	101.076	05.06.	1.750	87.500	N
BNP Paribas, Sydney Branch, Sydney, Australien												
	AUD	1'000.00	04.10.2013	04.10.2017	22 448 598		-	99.955	04.04. 04.10. 04.10.	4.500	16.983 17.265 0.34437	N
Emissionsdisagio von 0.045% 4.10.2017 Em.preis: 99.955%												
	AUD	1'000.00	21.05.2015	21.05.2020	28 273 873	%	102.410	99.819	21.05. 21.11.	3.750	13.540 14.219	N
BNZ International Funding Ltd (London Branch), London, Grossbritannien												
	EUR	1'000.00	23.11.2010	23.11.2017	12 045 999		-	99.364	23.11. 23.11.	3.125	36.335 7.395	N
Emissionsdisagio von 0.636% 23.11.2017 Em.preis: 99.364%												
	CHF	5'000.00	22.06.2012	22.01.2018	18 478 618	%	100.120	100.595	22.01.	1.500	75.000	N
	EUR	1'000.00	23.05.2013	23.05.2018	21 442 591	%	100.190	99.568	23.05.	1.250	13.638	N
	CHF	5'000.00	20.09.2012	20.09.2019	19 348 602	%	102.550	100.366	20.09.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	03.02.2014	03.02.2021	23 263 586	%	104.650	100.634	03.02.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	24.06.2015	24.06.2022	28 201 899	%	101.400	100.208	24.06.	0.250	12.500	N
BOC Aviation Ltd, Singapore, Singapur												
	AUD	2'000.00	03.09.2014	03.03.2021	25 279 163	%	105.740	99.957	03.03.	5.375	82.182	N
Boeing Capital Corporation, Renton, USA												
	USD	1'000.00	01.08.2011	15.08.2018	13 482 791	%	100.620	99.507	15.02. 15.08.	2.900	14.622 14.106	N
	USD	1'000.00	27.10.2009	27.10.2019	10 687 660	%	104.530	99.929	27.04. 27.10.	4.700	23.374 23.485	N
Boeing Company (The), Seattle, USA												
	USD	1'000.00	13.03.2009	15.03.2019	10 031 189	%	104.530	98.466	15.03. 15.09.	6.000	30.242 28.808	N
	USD	1'000.00	28.07.2009	15.02.2020	10 398 199	%	105.420	98.958	15.02. 15.08.	4.875	24.580 23.713	N
	USD	1'000.00	15.08.1991	15.08.2021	716 139	%	120.670	99.474	15.02. 15.08.	8.750	44.118 42.562	N
Bombardier Inc., Montreal, Kanada												
	USD	1'000.00	29.03.2010	15.03.2020	11 144 205	%	106.770	100.000	15.03. 15.09.	7.750	39.063 37.211	N
	USD	1'000.00	08.03.2012	15.03.2022	18 127 276	%	98.100	100.000	15.03. 15.09.	5.750	28.982 27.608	N
	USD	1'000.00	03.04.2014	15.10.2022	24 124 162	%	98.530	100.000	15.04. 15.10.	6.000	30.049 29.254	N
	USD	1'000.00	14.01.2013	15.01.2023	20 434 637	%	97.860	100.000	15.01. 15.07.	6.125	30.961 29.491	N
Boral Ltd, Sydney, Australien												
	CHF	5'000.00	20.02.2013	20.02.2020	20 447 724	%	104.400	100.378	20.02.	2.250	112.50	N
Borealis AG, Wien, Österreich												
	EUR	1'000.00	30.04.2010	30.04.2017	11 253 592		-	101.289	30.04.	5.375	58.326	N
Bouygues, Paris, Frankreich												
	EUR	50'000.00	12.02.2010	12.02.2018	10 971 307	%	100.360	99.651	12.02.	4.000	2'137.74	N
	EUR	50'000.00	29.10.2010	29.10.2019	11 947 195	%	106.540	100.000	29.10.	3.641	2'110.41	N
	EUR	100'000.00	09.02.2012	09.02.2022	14 868 111	%	117.090	99.660	09.02.	4.500	4'815.78	N
	EUR	100'000.00	02.10.2012	16.01.2023	19 594 096	%	115.950	99.681	16.01.	3.625	3'897.19	N
BP Capital Markets PLC, Sunbury on Thames, Grossbritannien												
	USD	1'000.00	07.05.2012	05.05.2017	18 531 843		-	100.000	05.05.	1.846	9.120	N
	CHF	5'000.00	14.06.2007	14.06.2017	3 098 368		-	101.185	14.06.	3.000	150.00	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	AUD	5'000.00	05.09.2012	05.09.2017	19 381 784		-	99.514	05.03. 05.09.	4.500	85.622 86.960	N
5.9.2017 Emissionsdisagio von 0.486% 5.9.2017 Em.preis: 99.514%									05.09.		18.630	
	USD	1'000.00	06.11.2012	06.11.2017	19 958 333		-	99.918	06.05. 06.11.	1.375	6.857 6.878	N
Emissionsdisagio von 0.082% 6.11.2017 Em.preis: 99.918%									06.11.		0.82046	
	CNY	10'000.00	08.10.2013	08.10.2018	22 516 508	%	99.600	100.000	08.04. 08.10.	3.950	28.752 29.267	N
	AUD	5'000.00	15.11.2013	15.11.2018	22 861 117	%	101.740	99.747	15.05. 15.11.	4.750	87.098 89.847	N
	GBP	1'000.00	10.03.2011	10.12.2018	12 649 745	%	103.280	99.886	10.12.	4.325	57.234	N
	EUR	1'000.00	16.02.2012	18.02.2019	14 997 673	%	103.410	100.000	18.02.	2.994	31.955	N
	USD	1'000.00	10.03.2009	10.03.2019	10 010 371	%	103.010	99.732	10.03. 10.09.	4.750	23.991 22.610	N
	USD	1'000.00	04.11.2014	15.01.2020	25 962 599	%	100.780	100.000	15.01. 15.07.	2.521	12.743 12.138	N
	EUR	1'000.00	01.06.2011	01.06.2020	13 107 100	%	109.890	100.000	01.06.	4.154	45.205	N
	CHF	5'000.00	28.02.2014	28.08.2020	23 805 309	%	103.450	101.074	28.08.	1.000	50.000	N
	USD	1'000.00	01.10.2010	01.10.2020	11 822 628	%	105.510	99.451	01.04. 01.10.	4.500	22.568 21.902	N
	USD	1'000.00	11.03.2011	11.03.2021	12 663 047	%	107.010	100.000	11.03. 11.09.	4.742	23.872 22.572	N
	CHF	5'000.00	26.09.2014	27.09.2021	25 528 670	%	103.500	100.792	27.09.	0.750	37.500	N
	USD	1'000.00	01.11.2011	01.11.2021	14 217 091	%	103.760	100.000	01.05. 01.11.	3.561	17.697 17.828	N
	USD	1'000.00	07.05.2012	06.05.2022	18 531 775	%	102.350	100.000	06.05. 06.11.	3.245	16.182 16.234	N
	EUR	1'000.00	25.09.2014	26.09.2022	25 527 171	%	105.210	100.000	26.09.	1.526	17.429	N
	USD	1'000.00	06.11.2012	06.11.2022	19 958 325	%	99.300	99.308	06.05. 06.11.	2.500	12.467 12.507	N
	USD	1'000.00	10.05.2013	10.05.2023	21 358 760	%	100.060	98.998	10.05. 10.11.	2.750	13.865 13.677	N
	USD	1'000.00	28.11.2016	28.11.2023	34 741 340	%	101.910	100.000	28.05. 28.11.	3.216	15.698 15.825	N
	CHF	5'000.00	28.02.2014	28.02.2024	23 805 312	%	109.450	101.019	28.02.	1.750	87.500	N
BPCE S.A., PARIS, Frankreich												
	SEK	1'000'000.00	28.03.2014	28.03.2017	24 054 590		-	99.845	28.03. 28.03.	2.125	2'380.87 173.66	N
Emissionsdisagio von 0.155% 28.3.2017 Em.preis: 99.845%												
6 3/4 % Euro Medium Term Note 2006-Perpetuelle	USD	2'000.00	27.01.2006	27.07.2017	2 408 708		-	100.000	27.01. 27.04. 27.07.	6.750	33.686 33.569 32.507	N
27.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
	AUD	10'000.00	17.04.2014	17.04.2018	24 232 923	%	100.490	100.000	17.04. 17.10.	4.500	171.42 172.68	N
	CHF	5'000.00	30.04.2014	30.04.2021	23 831 565	%	105.300	100.634	30.04.	1.500	75.000	N
	EUR	1.00	12.10.2012	12.10.2022	19 437 175	%	110.600	100.291	12.01. 12.04. 12.07. 12.10.	3.030	0.00813 0.00808 0.00834 0.00875	N
Brenntag Finance B.V., Dordrecht, Niederlande												
	EUR	1'000.00	19.07.2011	19.07.2018	13 358 682	%	102.240	99.321	19.07.	5.500	60.458	N
	USD	250'000.00	02.12.2015	02.12.2022	30 594 629	%	104.240	100.000	02.06. 02.12.	VAR.	2'284.14 2'346.51	N
BRFkredit AS, Kgs.Lyngby, Dänemark												
	EUR	1'000.00	31.01.2013	31.01.2018	20 560 594	%	99.910	99.467	31.01.	2.500	26.728	N
Brisbane Airport Corporation Pty Ltd, Brisbane Airport, Australien												
	AUD	10'000.00	21.10.2013	21.10.2020	22 580 203	%	107.590	99.845	21.04. 21.10.	6.000	224.77 231.48	N
British Columbia (Province of), Victoria, Kanada												
	CHF	5'000.00	27.03.2009	27.12.2017	4 875 852		-	100.582	27.12.	2.875	143.75	N
	CHF	5'000.00	07.04.2009	27.11.2018	10 034 568	%	103.280	101.119	27.11.	2.875	143.75	N
	USD	1'000.00	22.09.2011	22.09.2021	13 911 816	%	100.970	99.983	22.03. 22.09.	2.650	13.115 12.837	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
British Gas International Finance BV, Rotterdam, Niederlande												
22.2.2017 Rückkauf ausstehender Titel	USD	10'000.00	04.11.1991	04.11.2021	536 359	%	90.010	8.770		0.000	0.000	Y
British Telecommunications Plc, Grossbritannien												
Emissionsdisagio von 0.055% 23.6.2017 Em.preis: 99.945%	GBP	1'000.00	21.06.2007	23.06.2017	3 205 014		-	99.945	23.06. 23.06.	6.625	81.756 0.67873	N
	USD	1'000.00	12.12.2007	15.01.2018	3 613 641	%	100.100	99.736	15.01. 15.07.	5.950	30.076 28.649	N
	GBP	1'000.00	23.08.1994	26.03.2020	258 439	%	116.340	100.765	26.03.	8.625	106.62	N
BSH Bosch und Siemens Hausgeraete GmbH, München, Deutschland												
	CNY	1'000'000.00	24.07.2012	24.07.2017	19 028 536		-	100.000	24.01. 24.07.	3.800	2'790.72 2'640.75	N
Bulgarian Telecommunication Company EAD, Sofia, Bulgarien												
	EUR	1'000.00	22.11.2013	15.11.2018	22 899 411	%	100.200	100.000	15.05. 15.11.	6.625	36.243 38.688	N
Bundesimmobiliengesellschaft m.b.H., Wien, Österreich												
	CHF	5'000.00	02.04.2008	02.10.2017	3 853 923		-	100.934	02.10.	3.250	162.50	N
	CHF	5'000.00	12.10.2005	12.10.2018	2 272 340	%	102.230	100.260	12.10.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	16.07.2007	16.07.2019	3 183 543	%	106.050	100.930	16.07.	3.250	162.50	N
	CHF	5'000.00	01.09.2006	01.09.2031	2 667 431	%	135.350	101.035	01.09.	3.125	156.25	N
Bundeslaender Bundesrepublik Deutschland, Deutschland												
Emissionsdisagio von 0.107% 13.4.2017 Em.preis: 99.893%	EUR	1'000.00	13.04.2007	13.04.2017	3 046 925		-	99.893	13.04. 13.04.	4.250	45.375 1.142	N
Bundesrepublik Deutschland, Berlin, Deutschland												
	EUR	0.010	17.11.2006	04.01.2017	2 785 115		-	100.280	04.01.	3.750	0.0004	N
	EUR	1'000.00	27.01.2016	25.01.2017	31 159 218		-	100.000		0.000	0.000	Y
Emissionsdisagio von 0.3% 7.4.2017 Em.preis: 99.7%	EUR	0.010	07.04.2012	07.04.2017	18 517 691		-	99.700	07.04. 07.04.	0.500	0.00005 0.00003	N
	EUR	0.010	08.05.2015	16.06.2017	25 367 545		-	100.450	16.06.	0.000	0.000	N
Emissionsdisagio von 0.57% 13.10.2017 Em.preis: 99.43%	EUR	0.010	14.09.2012	13.10.2017	19 427 322		-	99.430	13.10. 13.10.	0.500	0.00005 0.00005	N
	EUR	0.010	20.11.2015	15.12.2017	30 405 981		-	100.799	15.12.	0.000	0.000	N
	EUR	0.010	16.11.2007	04.01.2018	3 542 653	%	100.010	98.450	04.01.	4.000	0.00043	N
	EUR	0.010	11.01.2013	23.02.2018	20 356 213	%	100.170	99.870	23.02.	0.500	0.00005	N
	EUR	0.010	10.05.2013	13.04.2018	21 313 000	%	100.300	99.380	13.04.	0.250	0.00002	N
	EUR	0.010	30.05.2008	04.07.2018	4 256 918	%	102.530	99.090	04.07.	4.250	0.00046	N
	EUR	0.010	06.09.2013	12.10.2018	22 226 077	%	101.340	99.980	12.10.	1.000	0.00011	N
	EUR	0.010	14.11.2008	04.01.2019	4 803 601	%	104.480	100.070	04.01.	3.750	0.0004	N
	EUR	0.010	17.01.2014	22.02.2019	23 290 048	%	101.990	100.500	22.02.	1.000	0.0001	N
	EUR	0.010	09.05.2014	12.04.2019	24 351 078	%	101.520	99.660	12.04.	0.500	0.00005	N
	EUR	0.010	22.05.2009	04.07.2019	10 207 743	%	106.410	99.690	04.07.	3.500	0.00038	N
	EUR	0.010	05.09.2014	11.10.2019	25 307 930	%	101.630	100.000	11.10.	0.250	0.00002	N
0% Zins-STRIPS 4.1.20	EUR	0.010	01.01.1999	04.01.2020	675 698	%	100.590	100.000		0.000	0.000	Y
	EUR	0.010	13.11.2009	04.01.2020	10 726 220	%	107.850	98.950	04.01.	3.250	0.00034	N
	EUR	0.010	23.01.2015	17.04.2020	26 696 742	%	101.380	99.810	17.04.	0.000	0.000	N
	EUR	0.010	30.04.2010	04.07.2020	11 241 642	%	108.990	100.260	04.07.	3.000	0.00032	N
	EUR	0.010	20.08.2010	04.09.2020	11 637 947	%	107.540	98.970	04.09.	2.250	0.00025	N
	EUR	0.010	03.07.2015	16.10.2020	28 691 815	%	102.240	100.430	16.10.	0.250	0.00002	N
0% Zins-STRIPS 4.1.21	EUR	0.010	04.07.1997	04.01.2021	675 699	%	100.670	100.000		0.000	0.000	Y
	EUR	0.010	26.11.2010	04.01.2021	12 033 624	%	109.100	99.210	04.01.	2.500	0.00026	N
	EUR	0.010	29.04.2011	04.07.2021	12 909 232	%	112.990	99.720	04.07.	3.250	0.00035	N
	EUR	0.010	26.08.2011	04.09.2021	13 643 031	%	109.820	100.880	04.09.	2.250	0.00025	N
	EUR	0.010	25.11.2011	04.01.2022	14 331 167	%	109.470	100.150	04.01.	2.000	0.00021	N
	EUR	0.010	13.04.2012	04.07.2022	18 349 652	%	109.210	99.770	04.07.	1.750	0.00019	N
	EUR	0.010	04.09.2012	04.09.2022	19 376 486	%	108.230	100.760	04.09.	1.500	0.00017	N
	EUR	0.010	18.01.2013	15.02.2023	20 418 652	%	108.560	99.410	15.02.	1.500	0.00016	N
	EUR	0.010	13.09.2013	15.08.2023	22 276 749	%	111.790	99.490	15.08.	2.000	0.00022	N
	EUR	0.010	04.01.1994	04.01.2024	166 160	%	137.790	100.400	04.01.	6.250	0.00067	N
	EUR	0.010	31.01.2014	15.02.2024	23 481 379	%	110.840	99.780	15.02.	1.750	0.00018	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	 %	 Brutto brut lordo CHF	IUP
	EUR	0.010	23.05.2014	15.05.2024	24 452 730	%	109.500	100.830	15.05.	1.500	0.00016	N
	EUR	0.010	12.09.2014	15.08.2024	25 363 108	%	106.350	99.550	15.08.	1.000	0.00011	N
	EUR	0.010	16.01.2015	15.02.2025	26 583 431	%	102.840	99.820	15.02.	0.500	0.00005	N
	EUR	0.010	17.07.2015	15.08.2025	28 851 705	%	106.440	101.180	15.08.	1.000	0.00011	N
	EUR	0.010	04.07.1997	04.07.2027	674 386	%	156.980	99.750	04.07.	6.500	0.00071	N
	EUR	0.010	04.01.1998	04.01.2028	843 480	%	150.730	101.740	04.01.	5.625	0.0006	N
	EUR	0.010	04.07.1998	04.07.2028	961 134	%	143.420	99.730	04.07.	4.750	0.00052	N
	EUR	0.010	04.01.2000	04.01.2030	1 037 111	%	165.750	100.060	04.01.	6.250	0.00067	N
0 % Zins-Strips 4.7.30	EUR	0.010	04.07.2015	04.07.2030	1 657 925	%	89.610	100.000		0.000	0.000	Y
	EUR	0.010	27.10.2000	04.01.2031	1 136 948	%	160.370	99.640	04.01.	5.500	0.00059	N
	EUR	0.010	27.10.2000	04.01.2031	1 148 167	%	90.020	100.000		0.000	0.000	Y
	EUR	0.010	31.01.2003	04.07.2034	1 589 778	%	84.910	100.000		0.000	0.000	Y
	EUR	0.010	28.01.2005	04.01.2037	2 049 192	%	153.290	99.210	04.01.	4.000	0.00043	N
	EUR	0.010	26.01.2007	04.07.2039	2 894 973	%	162.600	102.510	04.07.	4.250	0.00046	N
	EUR	0.010	04.07.2008	04.07.2040	4 541 840	%	76.460	100.000		0.000	0.000	Y
	EUR	0.010	04.07.2008	04.07.2040	4 423 998	%	174.750	97.480	04.07.	4.750	0.00052	N
	EUR	0.010	23.07.2010	04.07.2042	11 530 565	%	146.040	98.380	04.07.	3.250	0.00035	N
	EUR	0.010	27.04.2012	04.07.2044	18 433 920	%	130.260	101.930	04.07.	2.500	0.00027	N
	EUR	0.010	28.02.2014	15.08.2046	23 764 952	%	131.520	99.400	15.08.	2.500	0.00028	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Caisse Centrale Du Credit Immobilier De France SA 3CIF, Paris, Frankreich												
	EUR	1'000.00	12.11.2010	12.01.2018	11 984 644	%	99.760	99.595	12.01.	4.000	43.075	N
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, Paris, Frankreich												
	EUR	50'000.00	07.03.2011	07.03.2018	12 601 526	%	100.330	99.465	07.03.	3.250	1'742.48	N
	EUR	1'000.00	21.12.2004	25.10.2019	2 019 483	%	108.150	98.773	25.10.	4.000	46.770	N
	EUR	50'000.00	10.06.2009	25.04.2020	10 249 973	%	110.720	99.327	25.04.	4.250	2'306.26	N
	EUR	1'000.00	27.05.2005	25.10.2020	2 164 910	%	111.220	99.751	25.10.	3.750	43.846	N
	CHF	5'000.00	21.04.2009	21.04.2021	10 052 538	%	111.000	100.770	21.04.	3.000	150.00	N
	EUR	1'000.00	29.06.2010	25.04.2021	11 465 810	%	112.120	99.763	25.04.	3.375	36.628	N
	CHF	5'000.00	19.04.2011	19.04.2023	12 786 019	%	113.250	100.235	19.04.	2.375	118.75	N
	EUR	1'000.00	16.09.2014	25.11.2024	25 425 860	%	107.520	99.320	25.11.	1.375	16.075	N
	CHF	5'000.00	09.03.2011	09.12.2025	12 473 990	%	119.700	100.824	11.12.	2.500	125.69	N
Caisse des Depots et Consignations, Paris, Frankreich												
	CHF	100'000.00	13.11.2007	13.11.2017	3 449 313		-	100.590	13.11.	3.250	3'250.00	N
	CHF	100'000.00	16.07.2008	16.04.2018	4 314 079	%	101.290	100.875	16.04.	3.625	3'625.00	N
	CHF	200'000.00	16.12.2013	16.12.2020	22 900 100	%	104.950	101.017	16.12.	1.250	2'500.00	N
	CHF	200'000.00	13.11.2017	12.11.2027	38 694 934	%	100.900	100.446		0.300	0.000	N
Caisse Francaise de Financement Local, Paris La Defense, Frankreich												
	EUR	1'000.00	06.02.2002	06.02.2017	1 368 048		-	97.610	06.02.	5.250	56.126	N
Emissionsdisagio von 2.39% 6.2.2017 Em.preis: 97.61%									06.02.		25.480	
	USD	10'000.00	16.02.2007	16.02.2017	2 927 334		-	99.821	16.02.	5.250	524.28	N
Emissionsdisagio von 0.179% 16.2.2017 Em.preis: 99.821%									16.02.		17.875	
	CHF	5'000.00	09.08.2007	09.08.2017	3 250 856		-	100.202	09.08.	3.500	175.00	N
	EUR	1'000.00	13.11.2007	13.11.2017	3 529 506		-	99.322	13.11.	4.500	52.254	N
Emissionsdisagio von 0.678% 13.11.2017 Em.preis: 99.322%									13.11.		7.872	
	CHF	5'000.00	02.11.2009	02.05.2018	10 599 420	%	101.050	100.275	02.05.	2.500	125.00	N
	CHF	5'000.00	12.11.2009	12.08.2019	10 668 077	%	105.100	100.952	12.08.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	28.08.2007	28.08.2019	3 302 321	%	106.750	100.990	28.08.	3.500	175.00	N
Caisse Nationale des Autoroutes (CNA), Paris, Frankreich												
	EUR	1'000.00	30.01.2002	30.01.2017	1 359 867		-	99.532	30.01.	5.250	55.814	N
Emissionsdisagio von 0.468% 30.1.2017 Em.preis: 99.532%									30.01.		4.989	
	EUR	1'000.00	28.03.2003	28.03.2018	1 571 678	%	100.800	99.433	28.03.	4.500	48.100	N
	EUR	0.250	15.07.2005	15.07.2025	2 192 427	%	124.480	99.847	15.07.	3.750	0.01035	N
Caixa Geral de Depositos SA, Lisboa, Portugal												
	EUR	100'000.00	18.01.2013	18.01.2018	20 456 718	%	100.140	99.620	18.01.	3.750	4'027.44	N
CaixaBank, S.A., Valencia, Spanien												
	EUR	50'000.00	28.06.2006	26.01.2017	2 609 042		-	99.279	26.01.	4.250	2'274.97	N
Emissionsdisagio von 0.721% 26.1.2017 Em.preis: 99.279%									26.01.		384.88	
	EUR	100'000.00	31.10.2003	31.10.2018	1 707 740	%	104.000	99.532	31.10.	4.750	5'515.70	N
	EUR	50'000.00	18.01.2006	18.01.2021	2 405 799	%	110.520	99.250	18.01.	3.625	1'946.59	N
	EUR	50'000.00	28.06.2006	26.01.2022	2 609 047	%	117.030	99.650	26.01.	4.500	2'408.79	N
	EUR	100'000.00	17.02.2005	17.02.2025	2 070 305	%	121.510	98.787	17.02.	3.875	4'134.49	N
Camposol SA, Lima, Peru												
	USD	1'000.00	27.05.2016	15.07.2021	32 743 972	%	107.930	100.000	15.01.	10.500	53.076	N
									15.07.		50.557	

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Canada Government, Ottawa, Kanada												
	CAD	1'000.00	20.04.2017	01.09.2018	21 376 045	%	99.910	100.000	01.03. 01.09.	1.250	4.683 4.899	N
3.10.2017 Rückkauf ausstehender Titel 10.10.2017 Rückkauf ausstehender Titel 17.10.2017 Rückkauf ausstehender Titel 24.10.2017 Rückkauf ausstehender Titel 14.11.2017 Rückkauf ausstehender Titel 21.11.2017 Rückkauf ausstehender Titel 28.11.2017 Rückkauf ausstehender Titel 5.12.2017 Rückkauf ausstehender Titel 12.12.2017 Rückkauf ausstehender Titel 19.12.2017 Rückkauf ausstehender Titel 27.12.2017 Rückkauf ausstehender Titel												
	CAD	1'000.00	12.11.2013	01.03.2019	22 829 726	%	100.190	100.000	01.03. 01.09.	1.750	6.557 6.859	N
	EUR	1'000.00	13.01.2010	13.01.2020	10 892 751	%	108.000	99.412	13.01.	3.500	37.656	N
Canadian Imperial Bank of Commerce, Toronto, Kanada												
	CHF	5'000.00	30.06.2010	30.06.2017	11 387 228		-	100.861	30.06.	1.750	87.500	N
	AUD	2'000.00	21.12.2012	24.01.2018	20 249 220	%	100.150	101.342	24.01.	4.250	64.600	N
	AUD	2'000.00	27.03.2013	27.03.2018	20 968 067	%	100.710	101.360	27.03.	4.625	69.262	N
	CHF	5'000.00	13.02.2012	13.02.2019	14 872 396	%	101.900	100.965	13.02.	1.000	50.000	N
	AUD	2'000.00	25.07.2013	25.07.2019	21 893 013	%	103.610	101.470	25.07.	4.750	71.591	N
	CHF	5'000.00	22.12.2015	22.12.2025	30 539 825	%	100.350	100.648	22.12.	0.125	6.250	N
Cargill Incorporated, Wayzata, USA												
	EUR	50'000.00	29.05.2007	29.05.2017	3 127 633		-	99.073	29.05. 29.05.	4.875	2'659.67 505.74	N
Emissionsdisagio von 0.927% 29.5.2017 Em.preis: 99.073%												
	EUR	1'000.00	04.09.2012	04.09.2019	19 380 616	%	103.110	99.928	04.09.	1.875	21.355	N
Caribbean Development Bank, Wildey, Barbados												
	CHF	5'000.00	07.07.2016	07.07.2028	32 637 147	%	99.100	100.000	07.07.	0.297	14.850	N
Carlsberg Breweries A/S, Dänemark												
	EUR	1'000.00	03.07.2012	03.07.2019	18 923 814	%	103.920	99.377	03.07.	2.625	28.739	N
	EUR	1'000.00	15.11.2012	15.11.2022	20 006 499	%	110.440	99.480	15.11.	2.625	30.658	N
	EUR	1'000.00	06.09.2017	06.09.2023	38 145 390	%	98.650	99.254		0.500	0.000	N
CARPEVIGO AG, Holzkirchen, Deutschland												
	EUR	1'000.00	10.07.2007	30.06.2021	3 253 687	%	30.000	100.000	30.06.	3.000	32.767	N
Carpevigo Holding AG, Holzkirchen, Deutschland												
	EUR	1.00	09.11.2011	30.06.2021	14 292 241	%	30.000	100.000	31.08.	3.000	0.01713	N
Carrefour SA, Boulogne-Billancourt, Frankreich												
	EUR	1'000.00	19.12.2012	19.12.2017	20 248 792		-	99.613	19.12. 19.12.	1.875	21.867 4.513	N
Emissionsdisagio von 0.387% 19.12.2017 Em.preis: 99.613%												
	EUR	1'000.00	24.10.2011	24.10.2018	14 115 599	%	104.240	99.748	24.10.	VAR.	61.115	N
	EUR	1'000.00	22.05.2013	22.05.2019	21 418 446	%	102.420	99.819	22.05.	1.750	19.147	N
	EUR	1'000.00	29.07.2010	25.04.2021	11 571 677	%	112.180	100.000	25.04.	VAR.	42.055	N
Casino Guichard-Perrachon S.A., Saint-Etienne, Frankreich												
Euro Medium Term Note 2013-perp. fix to variable	EUR	100'000.00	24.10.2013		22 660 740	%	101.680	100.000	31.01.	4.870	5'206.61	N
	EUR	50'000.00	11.05.2010	12.11.2018	11 291 263	%	104.730	100.000	12.11.	5.731	3'327.41	N
Cassa Depositi e Prestiti S.p.A., Roma, Italien												
	EUR	1'000.00	20.03.2015	20.03.2022	27 417 876	%	99.910	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	VAR.	4.688 4.750 0.49324 0.50019	N
Caterpillar Financial Australia Ltd, Australien												
	AUD	10'000.00	31.05.2012	31.05.2017	18 687 593		-	99.407	31.05. 31.05.	4.750	170.60 42.713	N
Emissionsdisagio von 0.593% 31.5.2017 Em.preis: 99.407%												

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Caterpillar Financial Services Corp, Nashville, USA												
Tranche 845	USD	1'000.00	30.05.2012	01.06.2017	18 666 620		-	99.837	01.06. 01.06.	1.625	7.876 1.580	N
Emissionsdisagio von 0.163% 1.6.2017 Em.preis: 99.837%												
Tranche 811	USD	1'000.00	27.03.2008	15.04.2018	3 901 425	%	101.090	99.751	15.04. 15.10.	5.450	27.294 26.573	N
Tranche 820	USD	1'000.00	26.09.2008	01.10.2018	4 608 927	%	103.310	99.673	30.03. 30.09.	7.050	35.113 34.314	N
Tranche 821	USD	1'000.00	12.02.2009	15.02.2019	2 548 645	%	105.250	99.830	15.02. 15.08.	7.150	36.050 34.779	N
	USD	1'000.00	18.05.2016	18.05.2019	32 618 086	%	99.060	99.944	18.05. 18.11.	1.350	6.604 6.689	N
Tranche 846	USD	1'000.00	30.05.2012	01.06.2022	18 666 626	%	101.240	99.836	01.06. 01.12.	2.850	13.814 14.024	N
Caterpillar Inc., Peoria, USA												
	USD	1'000.00	05.12.2008	15.12.2018	4 889 076		-	99.832	15.06. 10.11. 10.11.	7.900	38.506 31.651 1.671	N
Emissionsdisagio von 0.168% 10.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
	USD	1'000.00	27.05.2011	27.05.2021	13 091 865	%	104.620	99.533	27.05. 27.11.	3.900	19.036 19.127	N
CBOM Finance PLC, Dublin, Irland												
	USD	1'000.00	07.11.2016	07.11.2021	34 444 288	%	104.260	100.000	07.05. 07.11.	5.875	29.298 29.344	N
CBQ Finance Ltd, Bermuda												
	USD	1'000.00	24.06.2014	24.06.2019	24 739 713	%	99.140	99.497	24.06. 24.12.	2.875	13.949 14.225	N
CEB Capital SA, Luxemburg												
	USD	1'000.00	15.11.2012	15.11.2019	20 012 814	%	104.080	100.000	15.05. 15.11.	8.500	42.356 42.062	N
Cedulas TDA 5, Fondo de Titulizacion de Activos, Madrid, Spanien												
	EUR	100'000.00	29.11.2004	29.11.2019	2 008 343	%	108.080	98.245	29.11.	4.125	4'810.98	N
Cedulas TDA 6, Fondo de Titulizacion de Activos, Madrid, Spanien												
	EUR	100'000.00	23.05.2005	23.05.2025	2 162 399	%	122.570	98.033	23.05.	3.875	4'227.81	N
Celesio Finance B.V., Baarn, Niederlande												
	EUR	1'000.00	26.04.2010	26.04.2017	11 237 378		-	99.273	26.04. 26.04.	4.500	48.683 7.865	N
Emissionsdisagio von 0.727% 26.4.2017 Em.preis: 99.273%												
Celgene Corporation, Summit, USA												
	USD	1'000.00	12.08.2015	15.08.2025	29 155 971	%	103.260	99.034	15.02. 15.08.	3.875	19.538 18.849	N
CEMEX (Cementos de Mexico), S.A.B. de C.V., Garza García, Mexiko												
	USD	1'000.00	02.10.2013	15.10.2018	22 457 354	%	101.000	100.000	17.01. 18.04. 17.07. 16.10.	VAR.	14.426 14.413 14.382 15.086	N
Central American Bank for Economic Integration CABEI, Tegucigalpa, Honduras												
	CHF	5'000.00	26.11.2014	26.11.2018	25 428 165	%	101.040	100.560	26.11.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	16.12.2013	16.12.2019	22 851 853	%	103.650	100.650	16.12.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	04.02.2013	04.02.2020	20 025 282	%	103.750	100.848	04.02.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	19.05.2015	19.11.2021	27 658 111	%	100.850	100.000	19.11.	0.194	9.700	N
	CHF	5'000.00	25.02.2014	25.02.2022	22 931 813	%	107.800	100.718	25.02.	1.875	93.750	N
	CHF	5'000.00	26.02.2016	26.08.2022	31 142 762	%	101.550	100.000	26.08.	0.371	18.550	N
	CHF	5'000.00	26.11.2014	24.02.2023	25 589 305	%	105.300	100.926	24.02.	1.125	56.250	N
CenturyLink, Inc., Monroe, USA												
	USD	1'000.00	12.03.2012	15.03.2042	18 127 333	%	84.500	99.905	15.03. 15.09.	7.650	38.559 36.731	N
Chevron Corporation, San Ramon, USA												
	USD	1'000.00	16.05.2016	16.05.2021	32 555 149	%	99.260	100.000	16.05. 16.11.	2.100	10.365 10.429	N
	USD	1'000.00	03.03.2015	03.03.2022	27 270 042	%	99.630	100.000	03.03. 03.09.	2.411	12.182 11.526	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Chiho Koei Kigyo-to Kinyu Kiko, Tokyo, Japan												
	JPY	10'000'000.00	25.06.2008	22.06.2018	4 340 989	%	100.580	99.900	22.06. 22.12.	1.900	827.17 831.52	N
	GBP	10'000.00	09.08.1999	09.08.2019	840 200	%	107.600	99.337	09.08.	5.750	721.50	N
China Construction Bank (Asia) Corp Ltd, Hong Kong, Hongkong												
	CNY	10'000.00	27.06.2014	27.06.2017	24 586 585		-	100.000	27.06.	3.450	24.370	N
	CHF	5'000.00	28.05.2014	28.05.2019	23 831 567	%	101.940	100.019	28.05.	1.375	68.750	N
China Construction Bank Corporation, Beijing, China (Volksrepublik)												
	CNY	10'000.00	19.10.2015	19.10.2017	30 102 198		-	100.000	19.04. 19.10.	4.300	31.072 31.694	N
China Development Bank, China (Volksrepublik)												
	CNY	10'000.00	19.09.2014	19.09.2017	25 464 156		-	100.000	20.03. 19.09.	3.350	24.113 24.552	N
China Overseas Finance (Cayman) V Ltd, Kaimaninseln												
	USD	1'000.00	15.11.2012	15.11.2022	19 997 988	%	102.470	99.665	15.05. 15.11.	3.950	19.683 19.546	N
China Shipping Overseas Finance 2013 Ltd, Britische Jungferninseln												
	USD	1'000.00	28.01.2014	28.01.2019	23 480 770	%	101.010	99.546	28.01. 28.07.	4.250	21.189 20.585	N
CIBA Specialty Chemicals Finance Luxembourg SA, Luxemburg												
	EUR	1'000.00	20.06.2003	20.06.2018	1 620 620	%	102.340	99.922	20.06.	4.875	52.935	N
Cie Financiere & Industrielle des Autoroutes COFIROUTE, SEVRES, Frankreich												
	EUR	50'000.00	24.05.2006	24.05.2021	2 560 531	%	115.770	98.928	24.05.	5.000	2'730.87	N
CIF Euromortgage, Paris, Frankreich												
	CHF	5'000.00	30.07.2010	30.01.2019	11 510 810	%	102.860	100.376	30.01.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	25.02.2010	05.03.2019	10 973 682	%	103.540	100.701	05.03.	2.375	118.75	N
	EUR	1'000.00	17.06.2010	17.06.2020	11 421 648	%	109.100	99.709	17.06.	3.500	38.067	N
Ciments Francais SA, Puteaux, Frankreich												
Emissionsdisagio von 0.289% 4.4.2017 Em.preis: 99.711%	EUR	50'000.00	04.04.2007	04.04.2017	3 017 250		-	99.711	04.04. 04.04.	4.750	2'536.38 154.31	N
Cisco Systems Inc., San Jose, USA												
Emissionsdisagio von 0.233% 14.3.2017 Em.preis: 99.767%	USD	1'000.00	16.03.2011	14.03.2017	12 669 435		-	99.767	14.03. 14.03.	3.150	15.872 2.348	N
	USD	1'000.00	03.03.2014	01.03.2019	23 812 547	%	100.040	99.929	01.03. 01.09.	2.125	10.719 10.227	N
Citigroup Inc., New York, USA												
Emissionsdisagio von 0.445% 30.1.2017 Em.preis: 99.555%	EUR	1'000.00	30.01.2007	30.01.2017	2 896 523		-	99.555	30.01. 30.01.	4.375	46.767 4.743	N
	NZD	1'000.00	29.06.2012	29.06.2017	18 917 445		-	100.000	29.06.	6.250	21.828	N
Emissionsdisagio von 0.085% 28.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	50'000.00	30.11.2005	30.11.2017	2 342 559		-	99.915	28.02. 28.02.	VAR.	127.16 45.226	N
	EUR	1'000.00	29.01.2013	29.01.2018	20 541 902	%	100.160	99.820	29.01.	1.750	18.706	N
	GBP	1'000.00	03.04.2008	03.04.2018	3 915 489	%	101.710	99.682	03.04.	7.625	95.440	N
	USD	1'000.00	01.05.2013	01.05.2018	21 268 076	%	99.790	99.929	01.05. 01.11.	1.750	8.697 8.761	N
	NOK	10'000.00	25.06.2013	25.06.2018	21 680 046	%	100.960	99.521	25.06.	3.000	34.332	N
	USD	1'000.00	30.10.1998	01.11.2018	969 301	%	103.600	99.412	01.05. 01.11.	6.950	34.539 34.796	N
	EUR	1'000.00	02.11.2006	02.11.2018	2 766 731	%	103.490	99.716	02.11.	4.375	50.951	N
	GBP	1'000.00	01.08.2003	12.12.2018	1 648 920	%	103.810	99.997	12.12.	5.125	67.765	N
	EUR	1'000.00	10.02.2004	10.02.2019	1 782 914	%	100.180	99.766	10.02. 10.05. 10.08. 10.11.	VAR.	2.968 2.904 3.099 3.178	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	CHF	5'000.00	21.03.2007	21.03.2019	2 936 510	%	104.060	100.005	21.03.	3.000	150.00	N
	EUR	1'000.00	02.08.2004	02.08.2019	1 915 087	%	107.680	99.493	02.08.	5.000	57.347	N
	GBP	1'000.00	02.09.1999	02.09.2019	889 983	%	108.350	98.694	02.09.	6.250	77.429	N
	EUR	1'000.00	04.08.2009	04.09.2019	10 410 361	%	112.470	99.073	04.09.	7.375	83.997	N
	NZD	1'000.00	12.11.2014	12.11.2019	26 005 545	%	103.840	100.000	12.05. 12.11.	5.130	17.478 17.767	N
	CHF	5'000.00	06.04.2006	06.04.2021	2 468 319	%	99.650	100.664	06.01. 06.04. 06.07. 06.10.	0.472	5.707 5.910 5.880 6.018	N
	CHF	5'000.00	27.09.2006	27.09.2021	2 679 122	%	111.800	100.620	27.09.	3.125	156.25	N
	USD	1'000.00	08.02.2013	30.07.2022	20 657 237	%	104.130	100.000	30.01. 30.07.	4.050	20.192 19.538	N
	GBP	1'000.00	01.07.2004	01.07.2024	1 891 681	%	120.870	99.954	01.07.	5.875	73.201	N
	CHF	5'000.00	22.05.2017	22.11.2024	36 550 147	%	101.250	100.258	22.11.	0.500	12.500	N
	EUR	1'000.00	25.02.2005	25.02.2030	2 073 863	%	117.510	98.715	25.02.	4.250	45.479	N
	USD	1'000.00	06.06.2002	15.06.2032	1 432 938	%	128.070	98.651	16.06. 15.12.	6.625	32.231 32.854	N
	USD	1'000.00	19.02.2003	22.02.2033	1 559 690	%	119.740	99.622	22.02. 22.08.	5.875	29.720 28.432	N
	USD	1'000.00	30.10.2003	31.10.2033	1 708 871	%	122.150	99.463	30.04. 30.10.	6.000	29.818 29.909	N
Clinicall Germany GmbH, Neuss, Deutschland												
	EUR	1'000.00	12.11.2015	12.11.2020	30 682 909	%	98.500	100.000	12.11.	6.500	75.478	N
CNH Industrial Capital LLC, USA												
	USD	1'000.00	08.04.2013	15.04.2018	21 087 780	%	99.940	100.000	15.04. 15.10.	3.625	18.154 17.674	N
CNH Industrial Finance Europe S.A., Luxemburg	USD	1'000.00	15.01.2015	15.07.2019	24 795 015	%	101.140	99.426	15.01. 15.07.	3.375	17.060 16.250	N
31.8.2017 Rückkauf ausstehender Titel	EUR	1'000.00	18.03.2014	18.03.2019	23 969 810	%	103.190	99.471	18.03.	2.750	29.473	N
CNOOC Finance 2013 Ld, Britische Jungferninseln	EUR	1'000.00	25.09.2014	27.09.2021	25 527 180	%	108.900	99.220	27.09.	2.875	32.875	N
	USD	1'000.00	09.05.2013	09.05.2023	21 325 498	%	98.900	98.477	09.05. 09.11.	3.000	15.080 14.973	N
CNPC General Capital Ltd, Road Town, Britische Jungferninseln												
Emissionsdisagio von 0.009% 19.4.2017 Em.preis: 99.991%	USD	1'000.00	19.04.2012	19.04.2017	18 411 828		-	99.991	19.04. 19.04.	2.750	13.723 0.08982	N
CNPC (HK) Overseas Capital Ltd, Britische Jungferninseln	USD	1'000.00	19.04.2012	19.04.2022	18 411 831	%	104.060	99.877	19.04. 19.10.	3.950	19.711 19.244	N
	USD	1'000.00	28.04.2011	28.04.2021	12 918 754	%	105.080	97.717	28.04. 28.10.	4.500	22.397 22.432	N
Coca Cola HBC Finance BV, Amsterdam, Niederlande												
	EUR	1'000.00	18.06.2013	18.06.2020	21 620 000	%	104.840	99.466	18.06.	2.375	25.831	N
Coca-Cola Amatil Limited, North Sydney, Australien												
	AUD	2'000.00	01.02.2012	01.02.2017	14 785 666		-	100.917	01.02.	4.875	73.363	N
	AUD	2'000.00	24.01.2013	06.02.2018	20 481 932	%	100.050	101.546	06.02.	4.125	62.734	N
	AUD	2'000.00	06.09.2012	06.09.2018	19 355 598	%	101.320	99.871	06.09.	4.500	68.590	N
	AUD	10'000.00	13.11.2012	13.11.2019	19 977 137	%	102.340	99.164	13.05. 13.11.	4.250	155.85 162.88	N
	AUD	2'000.00	04.06.2013	04.06.2020	21 479 462	%	103.660	100.938	04.06.	4.375	63.163	N
	AUD	2'000.00	25.11.2013	25.11.2020	22 821 077	%	105.850	100.719	25.11.	5.000	74.741	N
	AUD	2'000.00	21.05.2014	21.05.2021	24 409 883	%	105.300	101.107	21.05.	4.625	67.351	N
	AUD	2'000.00	12.08.2014	12.08.2021	25 069 483	%	103.940	99.200	12.08.	4.250	64.867	N
	AUD	2'000.00	10.03.2017	10.03.2022	35 904 978	%	100.240	101.236		3.375	0.000	N
	AUD	2'000.00	22.07.2016	22.07.2022	33 260 051	%	100.500	99.543	22.07.	3.125	46.907	N
	AUD	2'000.00	26.04.2017	26.04.2024	36 475 339	%	100.190	99.288		3.500	0.000	N
Coca-Cola Company (The), Atlanta, USA												
	CHF	5'000.00	02.10.2015	02.10.2017	29 797 487		-	100.100	02.10.	0.000	0.000	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	USD	1'000.00	14.03.2012	14.03.2018	18 163 518	%	100.040	99.767	14.03. 14.09.	1.650	8.313 7.976	N
	AUD	10'000.00	08.06.2016	09.06.2020	32 785 270	%	100.430	99.970	09.06. 09.12.	2.600	94.709 97.394	N
	USD	1'000.00	27.10.2015	27.10.2020	30 202 191	%	98.880	99.824	27.04. 27.10.	1.875	9.324 9.369	N
	USD	1'000.00	15.11.2010	15.11.2020	11 992 536	%	102.350	99.694	15.05. 15.11.	3.150	15.696 15.587	N
	USD	1'000.00	10.08.2011	01.09.2021	14 328 455	%	103.040	99.913	01.03. 01.09.	3.300	16.646 15.883	N
	CHF	5'000.00	02.10.2015	22.12.2022	29 797 488	%	101.350	100.099	22.12.	0.250	12.500	N
	EUR	1'000.00	09.03.2015	09.03.2023	27 309 256	%	101.620	99.776	09.03.	0.750	8.050	N
	USD	1'000.00	05.03.2013	01.04.2023	20 839 620	%	99.600	99.592	01.04. 01.10.	2.500	12.538 12.168	N
	EUR	1'000.00	09.03.2015	09.03.2027	27 309 253	%	101.170	99.023	09.03.	1.125	12.076	N
	CHF	5'000.00	02.10.2015	02.10.2028	29 797 489	%	107.700	100.853	02.10.	1.000	50.000	N
	EUR	1'000.00	09.03.2015	09.03.2035	27 293 486	%	101.030	99.594	09.03.	1.625	17.443	N
Coca-Cola Enterprises Inc., Atlanta, USA												
	USD	1'000.00	11.02.1992	01.02.2022	869 923	%	122.030	98.830	01.02. 01.08.	8.500	42.174 41.040	N
Coca-Cola European Partners US LLC, Atlanta, USA												
Emissionsdisagio von 0.309% 29.9.2017 Em.preis: 99.691%	EUR	1'000.00	29.09.2010	29.09.2017	11 787 435		-	99.691	29.09. 29.09.	3.125	35.745 3.534	N
	EUR	1'000.00	02.08.2012	05.12.2019	19 128 117	%	103.140	99.003	05.12.	2.000	23.364	N
	EUR	1'000.00	06.11.2013	06.11.2023	22 758 803	%	110.690	99.636	06.11.	2.625	30.430	N
Cofinoga Funding Two LP, Solihull, Grossbritannien	EUR	1'000.00	07.05.2013	07.05.2025	21 299 116	%	109.480	99.136	07.05.	2.375	25.895	N
Regd.Floating Rate Preferred Securities 2004-Without Fixed Maturity VRN on TEC10-CNO Idx Subord.	EUR	1'000.00	15.01.2004		1 744 600	%	96.000	100.000	15.01. 18.04. 15.07. 15.10.	VAR.	4.503 5.662 6.489 6.327	N
Colgate-Palmolive Company, New York, USA												
Tranche 94 Emissionsdisagio von 0.538% 15.1.2017 Em.preis: 99.462%	USD	1'000.00	08.11.2011	15.01.2017	14 269 103		-	99.462	15.01. 15.01.	1.300	6.571 5.439	N
Tranche 91 Emissionsdisagio von 0.44% 1.5.2017 Em.preis: 99.56%	USD	1'000.00	04.05.2011	01.05.2017	12 954 862		-	99.560	01.05. 01.05.	2.625	13.045 4.373	N
Tranche 98	USD	1'000.00	02.05.2013	01.05.2018	21 299 492	%	99.700	99.523	01.05. 01.11.	0.900	4.472 4.506	N
Tranche 97	USD	1'000.00	01.08.2012	01.02.2023	19 159 408	%	97.010	98.537	01.02. 01.08.	1.950	9.675 9.415	N
Colombia Telecomunicaciones SA ESP, Bogota, Kolumbien												
	USD	1'000.00	27.09.2012	27.09.2022	19 625 035	%	101.970	100.000	27.03. 27.09.	5.375	26.428 26.195	N
Colossa Vermoegensverwaltung GmbH, Leipzig, Deutschland												
	CHF	1'000.00	18.10.2016	18.10.2021	34 272 159	%	100.000	100.000	18.04. 18.10.	4.000	19.945 20.054	N
Columbia Asia Sdn Bhd, Malaysia												
	MYR	1'000.00	28.08.2012	28.08.2017	19 281 288		-	100.000	28.08.	0.000	0.000	N
Comcast Corporation, Philadelphia, USA												
Emissionsdisagio von 0.601%	USD	1'000.00	02.03.2006	15.03.2037	2 471 064		-	99.399	15.03. 15.09. 03.10.	6.450	32.510 30.969 5.852	N
Commerzbank AG, Frankfurt am Main, Deutschland												
	EUR	1'000.00	14.03.2012	14.03.2017	14 942 900		-	101.500	14.03.	9.500	50.536	N
Emissionsdisagio von 0.703% 22.3.2017 Em.preis: 99.297%	EUR	1'000.00	22.03.2010	22.03.2017	11 129 257		-	99.297	22.03. 22.03.	3.875	41.429 7.516	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Emissionsdisagio von 0.124% 10.7.2017 Em.preis: 99.876%	EUR	1'000.00	08.02.2012	10.07.2017	14 913 280		-	99.876	10.07. 10.07.	3.625	39.913 1.365	N
	EUR	1'000.00	30.10.2009	30.10.2017	10 715 013		-	100.000	30.10.	5.000	57.962	N
	EUR	100'000.00	28.02.2013	28.02.2018	20 781 122	%	100.270	99.776	28.02.	1.500	1'600.59	N
	EUR	1'000.00	31.03.2015	03.04.2018	27 673 818	%	100.200	99.973	03.04.	0.500	5.342	N
	EUR	1'000.00	22.03.2011	22.03.2019	12 727 775	%	107.520	100.000	22.03.	6.375	68.158	N
	GBP	10'000.00	31.08.1999	30.08.2019	890 564	%	107.830	99.102	30.08.	6.625	821.12	N
	EUR	1'000.00	23.07.2015	23.07.2020	28 954 738	%	101.300	99.639	23.07.	0.250	2.753	N
	EUR	100'000.00	16.03.2011	16.03.2021	12 672 493	%	121.140	100.000	16.03.	7.750	8'282.42	N
	EUR	1'000.00	21.09.2015	21.09.2022	29 705 473	%	105.130	99.526	21.09.	1.500	17.401	N
	EUR	1'000.00	13.09.2016	13.09.2023	33 876 880	%	98.920	99.221	13.09.	0.500	5.739	N
Tranche 1 Reg S	USD	1'000.00	19.09.2013	19.09.2023	22 363 344	%	119.000	100.000	20.03. 19.09.	8.125	40.488 38.895	N
Commerzbank Finance & Covered Bond S.A., Luxemburg	EUR	1'000.00	07.09.2015	08.09.2025	29 518 741	%	103.180	99.752	08.09.	0.875	9.968	N
	EUR	1'000.00	04.06.2003	04.06.2018	1 615 315	%	101.700	98.179	04.06.	4.250	46.129	N
	CHF	5'000.00	27.03.2006	27.03.2019	2 459 020	%	102.750	101.280	27.03.	2.500	125.00	N
	CHF	5'000.00	07.02.2005	07.02.2020	2 037 106	%	104.300	99.920	07.02.	2.750	137.50	N
	CHF	5'000.00	07.02.2005	07.02.2020	2 039 315	%	104.300	100.790	07.02.	2.750	137.50	N
	CHF	5'000.00	09.02.2006	09.02.2021	2 395 653	%	105.050	100.810	09.02.	2.375	118.75	N
	CHF	5'000.00	09.02.2007	09.02.2022	2 862 260	%	109.400	101.305	09.02.	2.750	137.50	N
	CHF	5'000.00	10.03.2005	10.03.2025	2 059 387	%	114.150	100.800	10.03.	2.875	143.75	N
Commonwealth Bank of Australia, Sydney, Australien	CHF	5'000.00	30.08.2005	29.08.2025	2 233 398	%	111.500	100.100	29.08.	2.500	125.00	N
Emissionsdisagio von 0.356% 12.1.2017 Em.preis: 99.644%	EUR	1'000.00	12.01.2012	12.01.2017	14 676 646		-	99.644	12.01. 12.01.	2.625	28.268 3.823	N
	CHF	5'000.00	09.11.2009	09.11.2017	10 659 691		-	100.420	09.11.	3.000	150.00	N
	EUR	1'000.00	06.04.2011	06.04.2018	12 808 631	%	101.120	99.786	06.04.	4.250	45.477	N
	USD	1'000.00	04.06.2003	15.06.2018	1 617 814	%	100.910	99.432	15.06. 15.12.	4.650	22.665 23.060	N
	USD	1'000.00	06.09.2016	06.09.2018	33 776 461	%	99.560	99.843	06.03. 06.09.	1.375	6.952 6.557	N
	CHF	5'000.00	25.09.2013	25.09.2018	22 243 329	%	101.280	100.743	25.09.	1.000	50.000	N
	NZD	1'000.00	15.10.2013	15.10.2018	22 516 086	%	102.150	101.173	15.10.	5.250	36.764	N
	NZD	1'000.00	01.08.2014	01.08.2019	25 008 131	%	103.950	101.491	01.08.	5.125	37.071	N
	CHF	5'000.00	13.03.2012	13.09.2019	18 007 146	%	103.400	100.725	13.09.	1.500	75.000	N
	AUD	1'000.00	24.09.2013	24.09.2019	22 322 564	%	104.190	101.518	24.09.	5.000	38.491	N
Tranche 81 Reg S	USD	1'000.00	15.10.2009	15.10.2019	10 649 629	%	104.370	99.448	15.04. 15.10.	5.000	25.041 24.379	N
	CHF	5'000.00	11.02.2013	11.02.2020	20 447 768	%	102.600	100.295	11.02.	0.875	43.750	N
	AUD	2'000.00	10.03.2014	10.06.2020	23 834 117	%	104.580	101.146	10.06.	4.750	69.452	N
	CHF	5'000.00	07.02.2014	07.02.2022	23 391 177	%	106.350	101.038	07.02.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	02.05.2012	02.05.2022	18 359 726	%	107.650	100.815	02.05.	1.625	81.250	N
Communaute Flamande, Brussels, Belgien	CHF	5'000.00	25.10.2017	25.09.2026	38 551 804	%	101.050	100.153		0.400	0.000	N
	EUR	50'000.00	20.03.2012	31.01.2018	18 177 599	%	100.280	99.979	31.01.	3.000	1'603.68	N
Compagnie de financement foncier, Paris, Frankreich												
Emissionsdisagio von 1.003% 24.1.2017 Em.preis: 98.997%	EUR	1'000.00	24.01.2005	24.01.2017	2 045 858		-	98.997	24.01. 24.01.	3.750	40.291 10.776	N
Emissionsdisagio von 0.787% 30.1.2017 Em.preis: 99.213%	AUD	1'000.00	30.01.2007	30.01.2017	2 894 970		-	99.213	30.01. 30.01.	6.250	23.745 5.931	N
Emissionsdisagio von 0.499% 23.9.2017 Em.preis: 99.501%	EUR	1'000.00	23.10.2007	23.09.2017	3 471 117		-	99.501	23.09. 23.09.	4.625	53.194 5.739	N
Emissionsdisagio von 0.98% 25.10.2017 Em.preis: 99.02%	EUR	1'000.00	19.01.2007	25.10.2017	2 874 070		-	99.020	25.10. 25.10.	4.125	48.231 11.458	N
	CHF	5'000.00	20.07.2010	20.12.2017	11 463 449		-	100.692	20.12.	2.000	100.00	N
	EUR	1'000.00	16.05.2003	16.05.2018	1 604 364	%	101.800	99.867	16.05.	4.500	49.236	N
	CHF	5'000.00	24.08.2005	24.08.2018	2 227 136	%	102.040	100.970	24.08.	2.375	118.75	N
	CHF	5'000.00	09.08.2011	09.08.2019	13 327 868	%	104.600	100.692	09.08.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	10.09.2009	10.09.2019	10 400 757	%	106.000	101.717	10.09.	2.875	143.75	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	EUR	1'000.00	04.10.2001	04.10.2021	1 301 776	%	121.750	99.012	04.10.	5.750	65.883	N
	CHF	5'000.00	13.10.2010	13.10.2021	11 761 537	%	109.550	100.384	13.10.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	07.06.2007	07.06.2022	3 087 611	%	114.050	100.700	07.06.	3.000	150.00	N
	CHF	5'000.00	19.02.2014	19.02.2024	23 478 919	%	109.700	100.079	19.02.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	23.08.2010	23.08.2030	11 545 753	%	125.000	102.192	23.08.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	24.02.2006	24.02.2031	2 414 110	%	126.000	102.250	24.02.	2.500	125.00	N
Conti-Gummi Finance BV, Maasstricht, Niederlande												
	EUR	1'000.00	19.09.2013	20.03.2017	22 359 243		-	99.595	20.03.	2.500	26.793	N
Emissionsdisagio von 0.405% 20.3.2017 Em.preis: 99.595%									20.03.		4.340	
Continental Aktiengesellschaft, Hannover, Deutschland												
	EUR	1'000.00	16.07.2013	16.07.2018	21 868 910	%	101.770	98.950	16.01.	3.000	16.214	N
									16.07.		16.433	
	EUR	1'000.00	09.09.2013	09.09.2020	22 270 037	%	108.260	99.228	09.09.	3.125	35.651	N
Cooperatieve Rabobank U.A., Utrecht, Niederlande												
	CHF	5'000.00	27.06.2008		4 317 439	%	102.300	100.437	27.06.	5.500	275.00	N
Regd.Noncumulative Capital Securities 2009-Without Fixed Maturity Variable Rate Reg-S Subord.	USD	1'000.00	04.06.2009		10 243 834	%	111.610	100.000	30.06.	11.000	52.670	N
									31.12.		53.596	
	EUR	1'000.00	16.01.2007	16.01.2017	2 870 624		-	99.936	16.01.	4.250	45.691	N
Emissionsdisagio von 0.064% 16.1.2017 Em.preis: 99.936%									16.01.		0.68617	
	MXN	1'000.00	24.05.2006	24.01.2017	2 553 133		-	100.300	24.01.	8.750	4.104	N
	AUD	1'000.00	30.01.2012	30.01.2017	14 725 549		-	82.000	30.01.	0.500	1.884	Y
30.1.2017 Em.preis: 82%												
	JPY	10'000'000.00	12.04.2007	12.04.2017	3 042 290		-	99.867	12.04.	1.850	1'697.37	N
Emissionsdisagio von 0.133% 12.4.2017 Em.preis: 99.867%									12.04.		122.02	
	NOK	10'000.00	18.04.2012	18.04.2017	18 344 144		-	101.035	18.04.	3.500	41.020	N
	EUR	1'000.00	21.04.2010	21.04.2017	11 227 794		-	99.559	21.04.	3.375	36.026	N
Emissionsdisagio von 0.441% 21.4.2017 Em.preis: 99.559%									21.04.		4.707	
	TRY	1'000.00	14.02.2013	02.05.2017	20 602 536		-	101.556	02.05.	6.125	17.239	N
	RUB	2'000'000.00	06.06.2007	06.06.2017	3 127 573		-	100.000	06.06.	6.900	2'346.82	N
	NZD	2'000.00	26.06.2014	26.06.2017	24 699 502		-	100.826	26.06.	4.750	67.353	N
Notes 2011-Without Fixed Maturity VRN Junior Subord. 29.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	09.11.2011	18.07.2017	14 257 626		-	100.000	29.06.	8.400	40.187	N
	ZAR	5'000.00	07.08.1997	07.08.2017	676 752		-	8.300		0.000	0.000	Y
	CHF	5'000.00	11.10.2005	11.10.2017	2 270 847		-	100.385	11.10.	2.125	106.25	N
	GBP	1'000.00	01.11.2010	01.11.2017	11 942 856		-	99.875	01.11.	3.250	43.137	N
Steuerbares Emissionsdisagio von 1.0343333333% (gewogenes Mittel der Emissionsdisagi von Grundanleihe und Aufstockungen) 1.11.2017 Em.preis: 99.875%									01.11.		13.728	
	AUD	1'000.00	13.11.2012	13.11.2017	19 953 624		-	101.069	13.11.	4.125	31.360	N
Tranche 2	CAD	1'000.00	20.11.2012	20.11.2017	19 997 550		-	101.280	20.11.	2.250	17.421	N
	EUR	1'000.00	15.01.2008	15.01.2018	3 676 705	%	100.120	99.891	15.01.	4.750	51.066	N
	ZAR	10'000.00	15.01.2014	15.01.2018	23 285 871	%	99.990	101.066	15.01.	7.500	55.552	N
	NOK	10'000.00	17.01.2014	17.01.2018	23 320 205	%	100.030	101.205	17.01.	2.375	28.189	N
	NZD	2'000.00	08.12.2014	19.01.2018	26 219 801	%	100.110	101.045	19.01.	4.500	65.419	N
	NOK	10'000.00	29.01.2013	29.01.2018	20 504 149	%	100.060	101.167	29.01.	2.875	34.572	N
	CHF	5'000.00	31.01.2011	31.01.2018	11 853 283	%	100.210	100.474	31.01.	2.000	100.00	N
	NZD	1'000.00	01.02.2013	02.05.2018	20 488 544	%	100.130	101.290	02.05.	4.250	29.260	N
	NOK	10'000.00	29.05.2013	29.05.2018	21 400 079	%	100.680	101.253	29.05.	2.625	30.473	N
	CAD	1'000.00	25.06.2013	25.06.2018	21 630 110	%	100.400	101.450	25.06.	2.625	19.239	N
	NZD	1'000.00	05.08.2014	05.08.2018	25 019 272	%	101.340	99.996	05.08.	5.000	35.780	N
	NOK	10'000.00	09.02.2015	09.08.2018	26 976 152	%	100.150	101.592	09.08.	1.125	13.633	N
	TRY	1'000.00	23.09.2013	03.09.2018	22 348 983	%	97.140	100.883	03.09.	9.250	25.781	N
	EUR	1'000.00	17.10.2011	17.10.2018	14 071 268	%	102.630	99.270	17.10.	3.500	40.311	N
	NZD	1'000.00	21.11.2013	21.11.2018	22 836 113	%	102.210	100.981	21.11.	5.125	34.733	N
	NOK	10'000.00	22.08.2013	20.12.2018	22 127 614	%	102.000	101.360	20.12.	3.000	35.233	N
	EUR	1'000.00	22.01.2014	22.01.2019	23 418 173	%	102.090	99.541	22.01.	1.750	18.833	N
	CHF	5'000.00	06.02.2012	06.02.2019	14 702 346	%	102.700	100.248	06.02.	2.000	100.00	N
	CAD	1'000.00	25.03.2014	25.03.2019	23 957 932	%	99.610	101.138	25.03.	2.375	17.453	N
	NOK	10'000.00	07.05.2013	07.05.2019	21 266 734	%	102.150	101.548	07.05.	2.875	33.199	N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	EUR	1'000.00	20.05.2009	20.05.2019	10 192 546	%	107.720	99.756	20.05.	5.875	64.281	N
	CHF	5'000.00	02.07.2009	02.07.2019	10 158 935	%	106.050	101.156	02.07.	3.625	181.25	N
	AUD	2'000.00	20.03.2015	22.07.2019	27 434 028	%	100.840	99.891	22.07.	3.000	45.031	N
	NZD	1'000.00	12.02.2014	12.08.2019	23 593 706	%	103.930	101.117	12.08.	5.375	38.070	N
	NOK	10'000.00	02.06.2014	02.09.2019	24 532 418	%	102.550	101.121	02.09.	2.625	32.190	N
	USD	1'000.00	02.12.2014	02.12.2019	26 195 284	%	99.760	99.948	02.12.	2.250	22.157	N
	NZD	1'000.00	16.07.2014	16.12.2019	24 852 254	%	104.840	101.242	16.12.	5.375	37.128	N
	EUR	1'000.00	14.01.2010	14.01.2020	10 896 071	%	108.470	99.582	14.01.	4.125	44.347	N
	AUD	2'000.00	20.01.2014	20.01.2020	23 273 302	%	104.470	101.526	20.01.	4.875	74.184	N
	NOK	10'000.00	20.01.2015	20.01.2020	26 657 368	%	100.680	101.639	20.01.	1.500	17.951	N
	EUR	50'000.00	19.03.2010	19.03.2020	11 133 133	%	114.610	100.000	19.03.	6.875	3'684.14	N
	AUD	1'000.00	29.04.2014	29.04.2020	24 285 367	%	103.890	101.161	29.04.	4.500	33.695	N
	CHF	5'000.00	26.06.2013	26.06.2020	21 527 551	%	103.050	100.180	26.06.	1.000	50.000	N
	NOK	10'000.00	04.09.2014	04.09.2020	25 318 925	%	103.010	101.520	04.09.	2.500	30.657	N
	NZD	2'000.00	04.03.2015	04.09.2020	27 249 964	%	103.970	101.491	04.09.	4.500	61.765	N
	ZAR	5'000.00	11.09.2014	11.09.2020	25 375 822	%	100.930	100.759	11.09.	8.250	30.353	N
	CHF	5'000.00	15.10.2012	15.10.2020	19 440 533	%	104.050	100.905	15.10.	1.250	62.500	N
	AUD	1'000.00	23.07.2014	23.11.2020	24 916 633	%	103.790	101.605	23.11.	4.250	31.810	N
	EUR	1'000.00	12.01.2011	12.01.2021	12 273 942	%	112.180	99.478	12.01.	4.125	44.421	N
	GBP	1'000.00	13.01.2011	13.01.2021	12 287 952	%	110.340	99.829	13.01.	4.625	57.031	N
	NOK	10'000.00	13.08.2015	13.01.2021	29 168 005	%	101.510	100.945	13.01.	1.750	20.838	N
	AUD	1'000.00	25.02.2014	25.02.2021	23 724 140	%	106.460	100.946	25.02.	5.000	38.763	N
	CHF	5'000.00	08.04.2014	08.04.2021	23 932 249	%	104.450	100.449	08.04.	1.125	56.250	N
	AUD	1'000.00	26.05.2014	26.05.2021	24 483 587	%	105.010	100.911	26.05.	4.500	32.642	N
	EUR	1'000.00	07.06.2006	07.06.2021	2 584 969	%	114.720	99.460	07.06.	4.375	47.488	N
	CHF	5'000.00	16.09.2010	16.09.2021	11 545 767	%	107.900	100.407	16.09.	2.000	100.00	N
	NOK	10'000.00	16.09.2016	16.09.2021	33 904 589	%	100.100	100.652	16.09.	1.250	15.359	N
	AUD	1'000.00	13.08.2014	13.10.2021	25 077 558	%	104.930	100.773	13.10.	4.250	32.669	N
	NOK	10'000.00	20.01.2017	20.01.2022	35 369 011	%	100.250	101.068		1.625	0.000	N
	GBP	1'000.00	23.03.2015	23.03.2022	27 503 779	%	103.810	99.641	23.03.	2.250	27.967	N
	EUR	1'000.00	06.06.2007	06.06.2022	3 143 283	%	119.920	99.652	06.06.	4.750	51.563	N
	NZD	1'000.00	08.06.2017	08.06.2022	37 003 664	%	101.540	99.887		3.625	0.000	N
	CHF	5'000.00	31.08.2007	31.08.2023	3 303 767	%	119.250	100.365	31.08.	3.500	175.00	N
	AUD	1'000.00	02.07.2015	02.07.2025	28 728 686	%	103.420	99.043	02.01. 02.07.	5.000	18.724 18.263	N
	CHF	5'000.00	15.09.2006	15.09.2026	2 662 084	%	123.900	100.980	15.09.	3.125	156.25	N
	ZAR	50'000.00	23.07.1997	23.07.2027	671 247	%	40.000	3.100		0.000	0.000	Y
	GBP	1'000.00	30.08.2005	30.08.2029	2 255 964	%	124.950	98.705	30.08.	4.550	56.394	N
Cooperativa Del Personal de la Universidad de Chile Ltda, Santiago, Chile												
	CHF	5'000.00	16.10.2017	15.10.2021	38 310 437	%	101.100	100.011		1.050	0.000	N
Corporacion Andina De Fomento, Caracas, Venezuela												
	CHF	5'000.00	03.11.2011	03.02.2017	14 093 994		-	100.714	03.02.	2.750	137.50	N
	CHF	5'000.00	11.09.2012	11.09.2018	19 225 186	%	101.510	100.404	11.09.	1.500	75.000	N
	USD	1'000.00	10.05.2016	10.05.2019	32 519 833	%	98.810	99.991	10.05. 10.11.	2.000	10.084 9.947	N
	CHF	5'000.00	13.08.2013	13.08.2020	21 908 004	%	104.500	100.321	13.08.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	11.02.2013	11.02.2021	20 456 732	%	104.750	100.794	11.02.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	24.02.2016	24.02.2022	31 045 183	%	100.700	100.134	24.02.	0.150	7.500	N
	CHF	5'000.00	07.09.2015	07.09.2023	29 208 619	%	101.850	100.216	07.09.	0.450	22.500	N
	CHF	5'000.00	05.02.2014	05.02.2024	22 517 333	%	111.500	100.252	05.02.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	16.03.2016	16.09.2024	31 595 590	%	100.450	100.000	16.09.	0.304	15.200	N
	CHF	5'000.00	07.04.2017	07.04.2025	36 017 272	%	100.150	100.079		0.300	0.000	N
	CHF	5'000.00	26.02.2015	26.02.2026	27 038 209	%	101.300	100.939	26.02.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	16.03.2016	16.09.2026	31 595 593	%	101.000	100.000	16.09.	0.510	25.500	N
	CHF	5'000.00	01.12.2014	01.12.2028	26 006 777	%	110.500	101.216	01.12.	1.500	75.000	N
Cosan Luxembourg S.A., Luxemburg												
	USD	1'000.00	14.03.2013	14.03.2023	20 908 889	%	99.250	98.839	14.03. 14.09.	5.000	25.193 24.172	N
Coventry Building Society, Coventry, Grossbritannien												
Regd.Capital Securities 2014-Without Fixed Maturity Variable Rate Reg-S Subord.	GBP	1'000.00	26.06.2014		24 732 035	%	103.850	100.000	01.05. 01.11.	6.375	40.623 42.656	N
Credit Agricole Home Loan SFH, Paris, Frankreich	GBP	1'000.00	16.10.2009	16.10.2019	10 659 307	%	108.750	99.392	16.04. 16.10.	6.000	37.740 38.953	N
	CHF	5'000.00	27.10.2010	27.07.2017	11 610 348		-	100.699	27.07.	1.750	87.500	N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	CHF	5'000.00	30.07.2012	30.07.2018	18 893 184	%	101.200	100.733	30.07.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	12.02.2014	12.08.2021	23 503 411	%	105.100	100.377	12.08.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	05.06.2014	05.06.2024	24 327 375	%	107.250	100.137	05.06.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	26.01.2016	26.01.2026	31 017 559	%	99.850	100.274	26.01.	0.100	5.000	N
	CHF	5'000.00	18.12.2015	18.06.2026	30 539 824	%	100.900	101.028	18.06.	0.250	12.500	N
	CHF	5'000.00	16.03.2015	16.03.2027	25 589 307	%	102.700	101.405	16.03.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	27.07.2017	27.07.2027	37 394 503	%	100.700	100.074		0.250	0.000	N
Credit Agricole S.A. London Branch, London, Grossbritannien												
	CHF	5'000.00	27.01.2015	27.01.2020	26 684 269	%	101.400	100.446	27.01.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	17.04.2014	17.07.2020	24 139 278	%	104.050	100.300	17.07.	1.250	62.500	N
	CHF	5'000.00	08.10.2014	08.10.2021	25 559 080	%	103.900	100.498	08.10.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	14.03.2017	14.03.2022	35 865 493	%	100.950	100.198		0.450	0.000	N
	CHF	5'000.00	01.09.2015	01.09.2022	29 208 671	%	102.300	100.326	01.09.	0.550	27.500	N
	CHF	5'000.00	13.03.2013	13.03.2023	20 447 730	%	108.400	101.248	13.03.	1.750	87.500	N
	CHF	5'000.00	16.03.2015	15.09.2023	26 288 336	%	102.450	100.489	15.09.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	18.10.2017	18.04.2024	37 926 876	%	100.400	100.097		0.300	0.000	N
	CHF	5'000.00	12.07.2017	12.07.2024	37 063 466	%	101.100	100.342		0.625	0.000	N
	CHF	5'000.00	23.04.2014	30.10.2024	23 831 566	%	112.550	100.978	30.10.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	27.01.2015	27.01.2025	26 684 270	%	105.100	100.833	27.01.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	29.09.2015	29.09.2025	29 298 445	%	109.650	100.403	29.09.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	14.06.2016	14.12.2026	32 373 567	%	100.900	100.383	14.12.	0.550	27.500	N
Credit Europe Bank N.V., Amsterdam, Niederlande												
	USD	1'000.00	24.01.2013	24.01.2023	20 504 445	%	100.750	100.000	24.01. 24.07.	8.000	39.960 37.840	N
Credit Mutuel Arkea, LE RELECQ KERHUON, Frankreich												
	EUR	100'000.00	23.01.2012	23.01.2017	14 714 455		-	100.000	23.01.	4.500	4'842.85	N
Emissionsdisagio von 0.883% 28.6.2017 Em.preis: 99.117%	EUR	50'000.00	28.06.2007	28.06.2017	3 208 038		-	99.117	28.06. 28.06.	5.000	2'727.62 481.69	N
CREDIT MUTUEL ARKEA HOME LOANS SFH, Brest, Frankreich												
	EUR	100'000.00	13.04.2011	13.04.2021	12 810 398	%	115.130	100.000	13.04.	4.500	4'804.42	N
	EUR	100'000.00	11.07.2013	11.07.2023	21 766 496	%	111.750	99.115	11.07.	2.375	2'626.39	N
Credit Mutuel-CIC Home Loan SFH, Paris, Frankreich												
Emissionsdisagio von 0.241% 25.4.2017 Em.preis: 99.759%	EUR	50'000.00	18.02.2010	25.04.2017	11 027 126		-	99.759	25.04. 25.04.	3.500	1'899.27 130.77	N
	EUR	100'000.00	22.04.2013	22.04.2020	21 189 693	%	103.910	99.980	22.04.	1.375	1'486.85	N
	EUR	50'000.00	09.09.2010	09.09.2020	11 717 700	%	109.080	99.628	09.09.	3.125	1'782.57	N
	EUR	100'000.00	17.03.2011	17.03.2021	12 664 282	%	114.570	99.968	17.03.	4.375	4'689.78	N
	EUR	100'000.00	14.01.2011	16.01.2023	12 300 761	%	119.550	99.470	16.01.	4.125	4'434.73	N
	EUR	100'000.00	19.01.2012	19.01.2024	14 726 880	%	122.880	99.028	19.01.	4.125	4'435.97	N
Credit Suisse AG, Guernsey Branch, St Peter Port, Guernsey												
	EUR	1'000.00	18.10.2011	18.10.2018	14 081 815	%	102.560	99.451	18.10.	2.875	33.239	N
Credit Suisse AG, London Branch, London, Grossbritannien	CHF	5'000.00	12.11.2010	12.11.2030	11 953 327	%	126.500	100.997	12.11.	3.125	156.25	N
Emissionsdisagio von 0.601% 25.1.2017 Em.preis: 99.399%	EUR	1'000.00	25.01.2010	25.01.2017	10 930 967		-	99.399	25.01. 25.01.	3.875	41.702 6.450	N
	USD	1'000.00	01.02.2012	01.02.2017	14 546 267		-	100.000	01.02.	3.100	16.373	N
	EUR	1'000.00	01.02.2012	01.02.2017	14 546 135		-	100.000	01.02.	2.850	16.281	N
	USD	1'000.00	28.02.2012	28.02.2017	14 778 102		-	100.000	28.02.	3.100	15.522	N
	CHF	1'000.00	28.03.2012	28.03.2017	14 997 664		-	100.000	28.03.	1.700	8.500	N
	CHF	1'000.00	26.05.2011	26.05.2017	12 862 138		-	100.000	27.02. 26.05.	VAR.	3.159 3.055	N
	CHF	5'000.00	07.07.2016	07.07.2017	32 829 811		-	100.604	07.07.	0.000	0.000	N
Steuerbares Emissionsdisagio von 1.45605% (gewogenes Mittel der Emissionsdisagi von Grundanleihe und Aufstockungen) 18.9.2017 Em.preis: 99.145%	EUR	1'000.00	18.09.2007	18.09.2017	3 405 159		-	99.145	18.09. 18.09.	5.125	58.832 16.714	N
	EUR	1'000.00	20.11.2014	20.11.2018	26 104 219	%	100.780	99.847	20.11.	0.625	7.277	N
	EUR	1'000.00	05.08.2009	05.08.2019	10 418 547	%	107.700	99.176	05.08.	4.750	54.482	N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	EUR	1'000.00	30.05.2014	29.11.2019	24 560 917	%	102.840	99.855	29.11.	1.375	16.036	N
	EUR	1'000.00	15.09.2015	15.09.2020	29 642 828	%	102.890	99.894	15.09.	1.125	12.924	N
	CHF	5'000.00	24.09.2014	24.09.2021	25 485 911	%	103.600	100.658	24.09.	1.000	50.000	N
	EUR	1'000.00	30.03.2016	30.03.2024	31 388 552	%	100.200	100.000	30.03.	4.000	42.774	N
	CHF	5'000.00	15.04.2016	15.04.2024	31 941 595	%	101.500	100.470	15.04.	0.550	27.500	N
	EUR	1'000.00	26.11.2015	26.11.2025	29 330 416	%	94.420	100.000	26.05. 26.11.	3.500	19.068 20.459	N
Credit Suisse AG Nassau Branch, Nassau, Bahamas												
	USD	1'000.00	07.04.2016	07.04.2022	31 562 254	%	98.700	100.000	07.01. 07.04. 07.07. 07.10.	VAR.	5.082 5.033 4.822 4.897	N
	USD	1'000.00	16.10.2015	17.10.2022	28 845 438	%	101.580	100.000	18.04. 16.10.	2.300	12.552 12.054	N
	USD	1'000.00	18.12.2015	19.12.2022	30 112 515	%	99.000	100.000	18.03. 18.06. 18.09. 18.12.	VAR.	5.979 5.843 5.761 5.913	N
	USD	1'000.00	18.12.2015	19.12.2022	30 112 514	%	101.370	100.000	19.06. 18.12.	2.400	12.660 12.740	N
	USD	1'000.00	04.02.2016	06.02.2023	30 112 553	%	98.620	100.000	04.02. 04.05. 04.08. 04.11.	VAR.	5.583 5.573 5.472 5.628	N
	USD	1'000.00	18.08.2016	18.08.2023	32 646 835	%	98.730	100.000	18.02. 18.05. 18.08. 18.11.	VAR.	5.887 5.748 5.650 5.822	N
	USD	1'000.00	30.11.2016	30.11.2023	34 112 893	%	98.190	100.000	28.02. 30.05. 30.08. 30.11.	VAR.	5.508 5.364 5.275 5.400	N
Credit Suisse AG, Sydney Branch, Sydney, Australien												
	AUD	10'000.00	16.07.2014	16.07.2019	24 916 514	%	102.480	99.084	16.01. 16.07.	4.000	152.39 149.32	N
Credit Suisse (Australia) Ltd, Sydney, Australien												
	AUD	10'000.00	29.04.2015	29.04.2020	28 012 742	%	101.880	99.739	29.04. 29.10.	3.500	130.67 134.31	N
	AUD	1'000.00	29.04.2015	29.04.2020	28 012 739	%	101.140	100.000	30.01. 28.04.	VAR.	5.439 5.240	N
Credit Suisse (Channel Islands) Limited, St Peter Port, Guernsey												
Bonds 2007-Without fixed maturity Fltg Rt 15.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	2'000.00	15.05.2007	26.05.2017	3 101 087		-	100.000	15.05.	5.860	58.402	N
Credit Suisse Group Funding (Guernsey) Limited, St Peter Port, Guernsey												
	USD	1'000.00	26.09.2015	26.03.2020	30 190 766	%	100.460	99.949	26.03. 26.09.	2.750	13.521 13.347	N
	CHF	5'000.00	21.08.2015	21.08.2020	29 277 465	%	101.450	100.468	21.08.	0.625	31.250	N
	USD	1'000.00	10.06.2016	10.12.2020	32 734 335	%	101.120	99.812	10.06. 10.12.	3.125	15.143 15.477	N
	USD	1'000.00	18.10.2016	16.04.2021	33 871 124	%	105.210	100.000	18.01. 18.04. 18.07. 18.10.	VAR.	8.118 8.273 8.307 9.016	N
	USD	1'000.00	18.10.2016	16.04.2021	33 871 121	%	102.300	99.996	18.04. 18.10.	3.450	17.226 16.935	N
	USD	1'000.00	15.09.2015	15.09.2022	29 679 873	%	102.090	99.829	15.03. 15.09.	3.800	19.153 18.245	N
	USD	1'000.00	15.09.2015	15.09.2022	30 190 769	%	103.130	99.829	15.03. 15.09.	3.800	19.153 18.245	N
	CHF	5'000.00	15.04.2015	14.04.2023	27 834 122	%	103.400	100.116	14.04.	1.000	50.000	N
	USD	1'000.00	10.06.2016	09.06.2023	32 850 380	%	98.600	99.714	10.06. 10.12.	3.800	18.413 18.821	N
	USD	1'000.00	10.06.2016	09.06.2023	33 871 135	%	102.990	99.714	10.06. 10.12.	3.800	18.413 18.821	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	USD	1'000.00	26.03.2015	26.03.2025	27 657 645	%	102.350	99.760	26.03. 26.09.	3.750	18.438 18.201	N
	USD	1'000.00	26.03.2015	26.03.2025	27 655 881	%	101.200	99.760	26.03. 26.09.	3.750	18.438 18.201	N
	USD	1'000.00	26.09.2015	26.03.2025	30 190 767	%	102.030	99.760	26.03. 26.09.	3.750	18.438 18.201	N
	USD	1'000.00	18.10.2016	17.04.2026	33 871 120	%	106.870	99.976	18.04. 18.10.	4.550	22.719 22.334	N
	USD	1'000.00	15.11.2015	15.05.2045	30 190 768	%	114.360	99.673	15.05. 15.11.	4.875	24.292 24.124	N
Credit Suisse Group (Guernsey) IV Limited, St Peter Port, Guernsey												
22.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	22.03.2012	22.03.2022	18 111 568		-	101.000	22.03.	7.125	231.25	N
Credit Suisse, New York Branch, New York, USA												
	CHF	5'000.00	14.03.2008	14.03.2018	3 797 239	%	101.060	101.055	14.03.	4.875	243.75	N
Crelan S.A., Bruxelles, Belgien												
	EUR	0.010	11.03.2010	11.03.2017	11 220 588		-	100.000	11.03.	4.000	0.00042	N
CRH-Caisse de Refinancement de l'Habitat, Paris, Frankreich												
Emissionsdisagio von 0.968% 25.4.2017 Em.preis: 99.032%	EUR	1.00	21.12.2005	25.04.2017	2 368 654		-	99.032	25.04. 25.04.	3.500	0.03798 0.0105	N
	CHF	5'000.00	23.05.2012	21.09.2017	18 477 725		-	100.292	21.09.	1.125	56.250	N
	EUR	1.00	30.06.2006	25.04.2018	2 599 747	%	101.370	97.950	25.04.	4.000	0.04341	N
	CHF	5'000.00	05.03.2012	05.03.2019	14 860 607	%	102.580	100.501	05.03.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	29.03.2011	29.03.2021	12 506 226	%	109.200	100.053	29.03.	2.500	125.00	N
	CHF	5'000.00	23.05.2012	23.05.2022	18 477 727	%	109.400	100.994	23.05.	1.875	93.750	N
	CHF	5'000.00	15.03.2013	15.03.2023	20 447 729	%	108.300	100.287	15.03.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	05.03.2012	05.03.2024	14 860 613	%	115.050	101.139	05.03.	2.375	118.75	N
	CHF	5'000.00	26.06.2013	26.06.2025	21 293 724	%	112.650	100.457	26.06.	1.750	87.500	N
CSN Islands XII Corp., George Town, Kaimaninseln												
7 % Notes 2010-Without Fixed Maturity Gtd Sr Reg S	USD	1'000.00	23.09.2010		11 772 748	%	79.080	100.000	23.03. 23.06. 23.09. 23.12.	7.000	17.367 16.953 16.958 17.317	N
CSN Resources SA, Luxemburg												
	USD	1'000.00	21.07.2010	21.07.2020	11 546 609	%	92.050	99.096	21.01. 21.07.	6.500	32.457 30.792	N
Czech Republic, Prague, Tschechische Republik												
	EUR	1'000.00	11.06.2008	11.06.2018	4 292 879	%	102.620	99.738	11.06.	5.000	54.282	N
	CZK	10'000.00	18.08.2003	18.08.2018	1 660 909	%	102.690	100.000	18.08.	4.600	19.899	N
	EUR	1'000.00	18.03.2005	18.03.2020	2 096 311	%	109.770	98.905	18.03.	4.125	44.209	N
	EUR	1'000.00	14.09.2010	14.04.2021	11 731 584	%	112.780	99.309	14.04.	3.625	38.720	N
	EUR	1'000.00	24.02.2012	24.05.2022	18 040 606	%	117.150	99.169	24.05.	3.875	42.328	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Daimler AG, Stuttgart, Deutschland												
	EUR	1'000.00	19.01.2010	19.01.2017	10 913 768		-	99.666	19.01.	4.125	44.359	N
Emissionsdisagio von 0.334% 19.1.2017 Em.preis: 99.666%									19.01.		3.581	
	NZD	2'000.00	03.04.2013	03.04.2017	21 004 569		-	101.237	03.04.	4.125	57.916	N
	AUD	2'000.00	05.04.2013	05.04.2017	21 055 266		-	101.029	05.04.	4.125	62.781	N
	EUR	1'000.00	05.03.2012	05.05.2017	18 083 470		-	99.354	05.05.	2.000	21.715	N
Emissionsdisagio von 0.646% 5.5.2017 Em.preis: 99.354%									05.05.		7.013	
	NOK	10'000.00	29.11.2012	29.11.2017	20 105 248		-	101.190	29.11.	2.875	34.387	N
	EUR	1'000.00	27.06.2012	27.06.2018	18 868 940	%	101.250	99.511	27.06.	2.125	23.142	N
	NOK	10'000.00	10.07.2013	10.07.2018	21 755 637	%	101.110	101.419	10.07.	3.000	34.762	N
	EUR	1'000.00	19.11.2013	19.11.2018	22 866 958	%	101.530	99.756	19.11.	1.500	17.465	N
	NOK	10'000.00	15.04.2014	10.12.2018	24 160 609	%	101.650	101.060	10.12.	2.750	32.545	N
	EUR	1'000.00	02.04.2012	02.04.2019	18 238 729	%	103.450	99.471	02.04.	2.625	28.048	N
	NZD	2'000.00	08.04.2015	08.04.2019	27 715 788	%	101.820	100.667	08.04.	4.000	56.121	N
	EUR	1'000.00	21.11.2012	21.01.2020	20 043 419	%	103.510	99.410	21.01.	1.750	18.832	N
	EUR	1'000.00	05.11.2015	05.03.2020	30 289 982	%	101.410	99.665	05.03.	0.625	6.698	N
	EUR	1'000.00	07.10.2013	07.04.2020	22 455 162	%	104.520	99.212	07.04.	2.000	21.377	N
	NOK	10'000.00	01.07.2015	01.10.2020	28 641 316	%	103.070	101.088	01.10.	2.000	24.361	N
	GBP	1'000.00	13.06.2014	04.12.2020	24 632 535	%	104.510	99.272	04.12.	2.750	36.500	N
	EUR	1'000.00	25.06.2013	25.06.2021	21 673 781	%	106.460	99.518	25.06.	2.000	21.741	N
	EUR	1'000.00	24.01.2014	24.01.2022	23 439 322	%	108.270	99.408	24.01.	2.250	24.241	N
Tranche 1	EUR	1'000.00	12.09.2012	12.09.2022	19 432 837	%	109.500	98.758	12.09.	2.375	27.244	N
	EUR	1'000.00	08.03.2013	08.03.2023	20 839 831	%	110.510	99.202	08.03.	2.375	25.436	N
	EUR	1'000.00	08.07.2014	08.07.2024	24 838 060	%	107.930	99.065	08.07.	1.875	20.644	N
Tranche 1 Reg S	EUR	1'000.00	15.11.2017	15.11.2027	39 060 375	%	98.290	99.349		1.000	0.000	N
Daimler Canada Finance Inc, Montreal, Kanada												
	CAD	2'000.00	02.04.2014	02.04.2019	24 023 221	%	100.210	101.077	02.04.	2.375	35.581	N
	NOK	10'000.00	20.01.2016	20.01.2021	31 096 570	%	100.980	101.389	20.01.	1.875	22.438	N
Daimler Finance North America LLC, Wilmington, DE, USA												
	USD	1'000.00	11.01.2012	11.01.2017	14 678 231		-	99.825	11.01.	2.950	15.098	N
Emissionsdisagio von 0.175% 11.1.2017 Em.preis: 99.825%									11.01.		1.791	
	USD	1'000.00	10.04.2012	10.04.2017	18 344 569		-	99.986	10.04.	2.400	12.096	N
Emissionsdisagio von 0.014% 10.4.2017 Em.preis: 99.986%									10.04.		0.14112	
	USD	1'000.00	02.03.2015	02.03.2018	27 253 507	%	100.030	100.000	02.03.	VAR.	3.422	N
									02.06.		3.655	
									05.09.		4.111	
									04.12.		4.274	
	USD	2'000.00	06.04.2016	06.04.2020	32 093 788	%	100.500	99.589	06.04.	2.125	21.335	N
									06.10.		20.783	
Daimler International Finance B.V., Utrecht, Niederlande												
	USD	2'000.00	10.04.2013	10.04.2018	21 087 360	%	99.870	99.820	10.04.	1.750	35.282	N
	GBP	1'000.00	06.02.2012	06.06.2019	14 890 344	%	103.660	99.181	06.06.	3.500	43.486	N
	NOK	10'000.00	24.05.2017	24.05.2022	36 818 851	%	101.010	99.891		1.750	0.000	N
Danone, Paris, Frankreich												
	EUR	100'000.00	27.11.2012	27.11.2017	20 083 271		-	99.749	27.11.	1.125	1'311.63	N
Emissionsdisagio von 0.251% 27.11.2017 Em.preis: 99.749%									27.11.		293.44	
	EUR	100'000.00	06.03.2013	06.06.2018	20 829 086	%	100.510	99.574	06.06.	1.250	1'356.93	N
	EUR	100'000.00	10.06.2013	10.06.2019	21 566 029	%	101.840	99.458	10.06.	1.375	1'492.76	N
	EUR	50'000.00	23.11.2010	23.11.2020	12 042 577	%	110.080	100.000	23.11.	3.600	2'092.95	N
	USD	1'000.00	06.06.2012	15.06.2022	18 717 512	%	100.620	99.699	15.06.	3.000	14.622	N
									15.12.		14.877	
	EUR	100'000.00	28.06.2013	28.06.2023	21 723 363	%	111.360	99.887	28.06.	2.600	2'836.73	N
Danske Bank AS, Kopenhagen, Dänemark												
	CHF	5'000.00	13.10.2009	13.01.2017	10 601 360		-	100.945	13.01.	2.375	118.75	N
	CHF	5'000.00	12.03.2010	12.09.2017	10 936 181		-	101.174	12.09.	2.250	112.50	N
	EUR	1'000.00	16.04.2010	16.04.2018	11 205 797	%	101.110	99.363	16.04.	3.500	37.385	N
	CHF	5'000.00	17.03.2011	17.05.2018	12 526 923	%	101.080	100.600	17.05.	2.125	106.25	N
	NOK	10'000.00	07.06.2013	07.06.2018	21 496 725	%	100.840	101.036	07.06.	3.000	34.034	N
	AUD	2'000.00	05.09.2013	05.09.2018	22 177 976	%	101.890	101.152	05.09.	5.000	76.668	N
	NOK	10'000.00	27.06.2014	27.06.2019	24 710 600	%	102.510	101.460	27.06.	2.750	31.459	N
	NZD	2'000.00	27.08.2014	27.08.2019	25 223 277	%	103.700	101.257	27.08.	5.250	72.697	N
	NZD	2'000.00	17.03.2015	17.03.2020	27 376 124	%	103.460	101.174	17.03.	4.500	62.946	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	GBP	1'000.00	29.09.2003	29.09.2021	1 681 617	%	102.980	99.913	29.09.	5.375	69.774	N
	CHF	5'000.00	18.12.2013	18.12.2025	23 027 782	%	107.850	100.752	18.12.	3.125	156.25	N
Danske Bank Plc, Helsinki, Finnland												
	ZAR	5'000.00	04.08.1997	04.08.2017	674 381		-	8.115		0.000	0.000	Y
Davide Campari-Milano S.p.A., Sesto San Giovanni, Italien												
	EUR	1'000.00	25.10.2012	25.10.2019	19 867 617	%	107.920	99.068	25.10.	4.500	52.616	N
	EUR	1'000.00	30.09.2015	30.09.2020	29 879 528	%	106.800	99.715	30.09.	2.750	31.417	N
de Volksbank NV, Utrecht, Niederlande												
	EUR	1'000.00	10.03.2010	10.03.2017	11 101 028		-	99.951		3.625		N
8.3.2017 Emissionsdisagio von 0.049%									08.03.		0.52479	
									08.03.		38.823	
8.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung 10.3.2017 Em.preis: 99.951%												
Deere & Company, Moline, USA												
	USD	1'000.00	08.06.2012	08.06.2022	18 778 326	%	100.000	99.746	08.06.	2.600	12.573	N
									08.12.		12.927	
Delhaize Le Lion / De Leeuw Comm.VA, Niederlande												
	EUR	100'000.00	27.11.2012	27.02.2020	20 084 004	%	106.360	99.709	27.02.	3.125	3'344.13	N
Dell Inc., Round Rock, USA												
	USD	1'000.00	15.10.2008	15.04.2018	4 579 220	%	100.340	99.736	15.04.	5.650	28.296	N
									15.10.		27.548	
	USD	1'000.00	10.09.2010	10.09.2040	11 736 882	%	90.700	99.926	10.03.	5.400	27.274	N
									10.09.		25.704	
Depfa ACS Bank DAC, Dublin, Irland												
	CHF	5'000.00	13.10.2005	13.10.2017	2 273 810		-	100.565	13.10.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	15.02.2006	15.02.2019	2 402 130	%	102.720	101.400	15.02.	2.375	118.75	N
	EUR	50'000.00	21.05.2004	21.05.2019	1 863 226	%	106.920	99.593	21.05.	4.875	2'666.99	N
	CHF	5'000.00	31.07.2006	31.07.2031	2 611 608	%	124.450	100.241	31.07.	3.250	162.50	N
	USD	1'000.00	15.03.2007	16.03.2037	2 985 779	%	124.680	98.389	16.03.	5.125	25.506	N
									16.09.		24.606	
DEPFA Pfandbrief Bank International S.A., Luxemburg												
	CHF	5'000.00	31.08.2006	31.08.2020	2 646 357	%	109.100	101.155	31.08.	3.125	156.25	N
Deutsche Bahn Finance B.V., Amsterdam, Niederlande												
	EUR	50'000.00	24.11.2006	16.01.2017	2 790 682		-	99.244	16.01.	4.000	2'150.17	N
Emissionsdisagio von 0.756% 16.1.2017 Em.preis: 99.244%									16.01.		405.27	
	CHF	5'000.00	21.02.2012	21.08.2017	14 383 841		-	100.595	21.08.	0.750	37.500	N
	EUR	1'000.00	14.03.2003	14.03.2018	1 571 986	%	100.930	99.369	14.03.	4.750	50.955	N
	EUR	50'000.00	24.07.2007	24.07.2019	3 259 716	%	108.240	99.215	24.07.	5.000	2'753.75	N
	EUR	1'000.00	10.06.2010	10.06.2020	11 394 440	%	109.120	99.701	10.06.	3.500	37.997	N
Deutsche Bahn Finance GmbH, Berlin, Deutschland												
	EUR	1'000.00	16.10.2009	16.10.2017	10 641 030		-	99.468	16.10.	3.625	41.703	N
Emissionsdisagio von 0.532% 16.10.2017 Em.preis: 99.468%									16.10.		6.120	
	GBP	1'000.00	30.10.2012	30.10.2017	19 886 788		-	99.861	30.10.	1.375	18.087	N
Emissionsdisagio von 0.139% 30.10.2017 Em.preis: 99.861%									30.10.		1.828	
	CHF	5'000.00	18.08.2011	18.12.2017	13 420 842		-	100.464	18.12.	1.500	75.000	N
	EUR	50'000.00	12.03.2009	12.03.2019	4 876 514	%	106.150	99.628	12.03.	4.875	2'618.36	N
	CHF	5'000.00	03.12.2010	03.06.2020	12 009 639	%	105.450	100.344	03.06.	1.750	87.500	N
	EUR	1'000.00	01.06.2011	01.06.2021	13 090 895	%	113.170	99.672	01.06.	3.750	40.809	N
	EUR	1'000.00	23.09.2009	23.09.2021	10 555 588	%	116.220	99.688	23.09.	4.375	50.319	N
	GBP	1'000.00	20.06.2012	20.06.2022	18 816 756	%	106.620	99.715	20.06.	2.750	33.861	N
	EUR	1'000.00	04.11.2010	04.11.2022	11 949 268	%	115.720	99.437	04.11.	3.375	39.124	N
	EUR	1'000.00	20.11.2012	20.02.2023	20 027 598	%	109.040	99.236	20.02.	2.000	21.346	N
	CHF	5'000.00	24.07.2013	24.07.2023	21 293 725	%	108.250	101.026	24.07.	1.375	68.750	N
	EUR	1'000.00	12.09.2013	12.09.2023	22 270 042	%	112.240	99.624	12.09.	2.500	28.678	N
	CHF	5'000.00	21.02.2012	21.02.2024	14 383 839	%	109.500	100.232	21.02.	1.500	75.000	N
	EUR	1'000.00	08.03.2012	08.03.2024	18 082 399	%	116.080	99.129	08.03.	3.000	32.130	N
	CHF	5'000.00	26.02.2014	26.08.2024	23 583 415	%	110.050	100.944	26.08.	1.500	75.000	N
	EUR	1'000.00	09.07.2010	09.07.2025	11 500 838	%	123.970	98.977	09.07.	3.750	41.289	N
	CHF	5'000.00	01.12.2015	01.12.2025	30 313 852	%	100.350	100.025	01.12.	0.100	5.000	N
	EUR	1'000.00	19.03.2014	19.03.2029	23 924 990	%	117.880	98.685	19.03.	2.750	29.473	N
	CHF	5'000.00	08.11.2017	08.11.2030	38 599 710	%	101.050	100.316		0.450	0.000	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Deutsche Bank AG, Frankfurt am Main, Deutschland												
Emissionsdisagio von 0.832% 31.8.2017 Em.preis: 99.168%	EUR	50'000.00	31.08.2007	31.08.2017	3 374 605		-	99.168	31.08. 31.08.	5.125	2'927.78 475.30	N
	EUR	1'000.00	06.04.2011	06.04.2018	12 806 323	%	100.990	99.357	06.04.	3.375	36.114	N
	ZAR	5'000.00	16.04.1998	16.04.2018	873 717	%	97.540	9.125		0.000	0.000	Y
	EUR	1'000.00	26.06.2009	26.06.2019	10 675 327	%	103.110	100.000	26.06.	VAR.	34.209	N
	NZD	2'000.00	27.08.2014	27.08.2019	25 243 129	%	103.150	99.990	27.08.	5.250	72.697	N
	NOK	10'000.00	24.06.2015	24.06.2020	28 636 946	%	100.000	99.281	24.06.	2.375	27.179	N
	USD	1'000.00	20.08.2015	20.08.2020	29 297 053	%	100.110	99.829	20.02. 20.08.	2.950	14.781 14.165	N
	CHF	5'000.00	05.04.2016	05.07.2021	32 029 789	%	101.750	100.264	05.07.	0.750	37.500	N
	EUR	100.00	13.08.2015	13.08.2021	29 088 509	%	100.840	100.000	13.08.	1.100	1.257	N
	EUR	100.00	03.03.2016	03.09.2021	31 603 562	%	100.030	100.000	03.03.	1.000	1.067	N
	ITL	5'000'000.00	15.10.1996	15.10.2021	526 334	%	96.410	11.740		0.000	0.000	Y
	USD	100.00	03.11.2015	05.11.2021	30 353 265	%	96.090	100.000	05.11.	2.350	2.351	N
	CHF	5'000.00	21.03.2017	21.03.2022	35 818 121	%	101.650	100.368		0.750	0.000	N
	EUR	1'000.00	08.06.2012	08.06.2022	18 747 550	%	107.240	99.005	08.06.	1.750	18.993	N
	NOK	10'000.00	20.09.2016	20.09.2022	33 967 785	%	101.020	99.004	20.09.	2.500	30.831	N
	EUR	100.00	03.03.2016	03.03.2023	31 603 537	%	100.500	100.000	03.03.	1.200	1.280	N
	NZD	2'000.00	25.08.2017	25.08.2023	37 989 664	%	100.160	100.000		4.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	19.03.2015	19.12.2023	27 392 598	%	100.850	100.565	19.12.	0.625	31.250	N
	EUR	1'000.00	17.02.2015	17.02.2025	27 107 520	%	102.650	99.715	17.02.	2.750	29.341	N
	DKK	10'000.00	18.11.1996	18.11.2026	532 540	%	81.370	11.000	18.11.	0.000	0.000	N
Deutsche Bank AG, London Branch, London, Grossbritannien												
Tranche 472 Emissionsdisagio von 0.009% 13.2.2017 Em.preis: 99.991%	USD	1'000.00	13.02.2014	13.02.2017	23 675 782		-	99.991	13.02. 13.02.	1.400	7.035 0.09045	N
	USD	1'000.00	13.02.2015	13.02.2018	27 128 422	%	99.950	99.881	13.02. 13.08.	1.875	9.422 9.094	N
Tranche 473	USD	1'000.00	13.02.2014	13.02.2019	23 675 783	%	99.910	99.953	13.02. 13.08.	2.500	12.424 12.126	N
	NOK	10'000.00	24.02.2015	24.02.2020	27 126 936	%	100.450	99.463	24.02.	1.625	19.664	N
	EUR	1'000.00	18.11.2015	18.11.2025	30 593 718	%	97.280	100.000	18.11.	2.000	23.287	N
Deutsche Bank AG New York, New York, USA												
	USD	1'000.00	16.11.2017	16.11.2022	39 149 540	%	99.160	99.922		3.300	0.000	N
Deutsche Bank Contingent Capital Trust IV, USA												
8 % Trust Pref.Secs 2008-o.f. Verfall subordinated	EUR	1'000.00	15.05.2008		4 239 446	%	103.060	100.000	15.05.	8.000	87.532	N
Deutsche Börse AG, Frankfurt am Main, Deutschland												
	EUR	1'000.00	26.03.2013	26.03.2018	20 994 262	%	100.310	99.331	26.03.	1.125	12.041	N
	EUR	1'000.00	05.10.2012	05.10.2022	19 692 802	%	110.670	99.141	05.10.	2.375	27.206	N
	EUR	1'000.00	08.10.2015	08.10.2025	29 964 745	%	108.240	98.926	08.10.	1.625	18.684	N
	EUR	1'000.00	05.08.2015	05.02.2041	29 124 236	%	106.550	100.000	05.02.	2.750	29.399	N
Deutsche ETP GmbH & CO.KG, Berlin, Deutschland												
	EUR	100.00	17.04.2009	30.11.2028	10 248 738	%	77.000	100.000	01.07.	3.000	3.293	N
Deutsche Hypothekenbank (Actien-Gesellschaft), Hannover, Deutschland												
	CHF	5'000.00	08.03.2006	08.03.2018	2 431 872	%	100.570	101.015	08.03.	2.500	125.00	N
Deutsche Lufthansa AG, Köln, Deutschland												
	EUR	1'000.00	12.08.2015	12.08.2075	29 168 048	%	110.470	99.448	12.02.	5.125	54.779	N
Deutsche Pfandbriefbank AG, München, Deutschland												
Emissionsdisagio von 1.021% 18.1.2017 Em.preis: 99.254%	EUR	1'000.00	18.01.2010	18.01.2017	10 909 350		-	98.979	18.01. 18.01.	3.375	36.246 10.935	N
	CHF	5'000.00	09.03.2005	09.03.2017	2 062 552		-	100.580	09.03.	2.500	125.00	N
Emissionsdisagio von 0.201% 11.9.2017 Em.preis: 99.799%	EUR	1'000.00	05.09.2013	11.09.2017	22 268 837		-	99.799	11.09. 11.09.	2.250	25.669 2.293	N
	EUR	1'000.00	24.01.2003	15.01.2018	1 546 447	%	100.150	97.748	15.01.	4.500	48.378	N
	ITL	1'000'000.00	30.01.1998	30.01.2018	839 944	%	101.070	100.875	30.01.	VAR.	0.000	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	USD	200'000.00	15.01.2014	15.01.2019	23 402 058	%	98.190	100.000	17.01. 18.04. 17.07. 16.10.	VAR.	441.19 516.56 551.58 628.55	N
	EUR	1'000.00	01.06.2012	03.06.2019	18 682 347	%	103.510	99.800	03.06.	2.125	23.064	N
	EUR	1'000.00	17.09.2014	17.09.2019	25 438 653	%	102.310	99.785	17.09.	1.500	17.219	N
	CHF	5'000.00	02.11.2016	02.11.2021	34 144 030	%	99.950	100.074	02.11.	0.300	15.000	N
	CHF	5'000.00	19.09.2006	19.09.2023	2 671 427	%	116.750	101.550	19.09.	3.125	156.25	N
	EUR	1'000.00	04.02.2005	04.02.2025	2 049 913	%	87.660	44.340	04.02.	0.000	0.000	N
Deutsche Pfandbriefbank AG, Frankfurt am Main, Deutschland												
1. Aufstockung	CHF	5'000.00	15.07.2005	09.03.2017	2 186 443		-	103.390		2.500	0.000	N
2. Aufstockung	CHF	5'000.00	29.05.2006	09.03.2017	2 540 115		-	96.710		2.500	0.000	N
Deutsche Post AG, Bonn, Deutschland												
	EUR	1'000.00	09.10.2013	09.10.2018	22 491 662	%	101.350	99.205	09.10.	1.500	17.247	N
	EUR	1'000.00	11.12.2012	11.12.2020	20 184 029	%	105.550	99.048	11.12.	1.875	21.908	N
	EUR	1'000.00	09.10.2013	09.10.2023	22 491 273	%	113.240	99.277	09.10.	2.750	31.619	N
	EUR	1'000.00	11.12.2012	11.12.2024	20 184 156	%	115.110	99.750	11.12.	2.875	33.592	N
Deutsche Post Finance B.V., The Netherlands, Niederlande												
Emissionsdisagio von 0.533% 27.6.2017 Em.preis: 99.467%	EUR	1'000.00	25.06.2012	27.06.2017	18 864 129		-	99.467	27.06. 27.06.	1.875	20.419 5.804	N
Deutsche Postbank AG, Bonn, Deutschland	EUR	1'000.00	25.06.2012	27.06.2022	18 864 132	%	112.150	99.471	27.06.	2.950	32.126	N
	EUR	1'000.00	15.02.2011	15.02.2021	12 477 523	%	111.620	99.088	15.02.	3.625	38.757	N
Deutsche Postbank Funding Trust II Delaware USA, Wilmington, DE, USA												
Notes 2004-without fixed maturity floating rate subordinated	EUR	1'000.00	23.12.2004		2 022 970	%	102.100	100.000	23.12.	VAR.	44.030	N
Deutsche Postbank Funding Trust IV, Wilmington, USA												
Non-Cumulative Trust Preferred Securities 2007-Without Fixed Maturity Variable Rate Reg-S Sr Subord. 29.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	50'000.00	29.06.2007	11.07.2017	3 216 885		-	100.000	29.06.	5.983	3'270.75	N
Deutsche Telekom AG, Bonn, Deutschland												
Emissionsdisagio von 0.333% 23.3.2017 Em.preis: 99.667%	AUD	2'000.00	23.03.2012	23.03.2017	18 193 220		-	99.667	23.03. 23.03.	5.875	89.123 5.051	N
Emissionsdisagio von 0.337% 22.5.2017 Em.preis: 99.663%	NOK	10'000.00	22.05.2012	22.05.2017	18 595 740		-	99.663	22.05. 22.05.	3.625	42.287 3.931	N
Deutsche Telekom International Finance BV, Amsterdam, Niederlande												
Emissionsdisagio von 0.192% 20.1.2017 Em.preis: 99.808%	EUR	1'000.00	20.01.2009	20.01.2017	4 972 708		-	99.808	20.01. 20.01.	6.000	64.586 2.061	N
Emissionsdisagio von 0.563% 6.3.2017 Em.preis: 99.437%	USD	1'000.00	06.03.2012	06.03.2017	18 094 937		-	99.437	06.03. 06.03.	2.250	11.376 5.693	N
	EUR	1'000.00	01.04.2003	29.03.2018	1 584 175	%	101.620	99.000	29.03.	VAR.	71.010	N
	USD	1'000.00	18.08.2008	20.08.2018	4 499 246	%	102.890	99.985	20.02. 20.08.	6.750	33.823 32.411	N
	USD	1'000.00	22.06.2009	08.07.2019	10 280 302	%	105.340	99.371	08.01. 08.07.	6.000	30.497 29.004	N
	EUR	1'000.00	30.10.2012	30.10.2019	19 900 960	%	103.860	99.716	30.10.	2.000	23.185	N
	GBP	1'000.00	04.12.2002	04.12.2019	1 522 768	%	111.920	98.893	04.12.	7.375	97.887	N
	EUR	1'000.00	16.03.2010	16.03.2020	11 118 094	%	109.340	99.346	16.03.	4.250	45.419	N
	EUR	1'000.00	17.01.2013	18.01.2021	20 446 310	%	106.190	99.072	18.01.	2.125	22.822	N
	USD	1'000.00	19.09.2016	19.09.2021	33 961 067	%	97.170	99.839	19.03. 19.09.	1.950	9.717 9.386	N
	EUR	1'000.00	24.10.2012	24.10.2024	19 860 115	%	113.680	98.538	24.10.	2.750	32.012	N
	EUR	1'000.00	22.04.2010	22.04.2025	11 225 403	%	129.060	99.895	22.04.	4.875	52.715	N
	EUR	1'000.00	17.01.2013	17.01.2028	20 446 408	%	118.530	98.720	17.01.	3.250	34.943	N
	GBP	1'000.00	06.07.2000	15.06.2030	1 099 331	%	153.780	98.691	15.06. 15.12.	VAR.	47.427 50.359	N
	EUR	1'000.00	28.10.2010	28.10.2030	11 932 750	%	132.430	98.519	28.10.	4.500	52.166	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Development Bank of Japan Inc., Tokyo, Japan												
Emissionsdisagio von 0.054% 17.3.2017 Em.preis: 99.946%	JPY	10'000'000.00	22.05.2007	17.03.2017	3 116 029		-	99.946	17.03. 17.03.	1.750	768.61 47.827	N
Development Bank of Kazakhstan JSC, Astana, Kasachstan												
	USD	1'000.00	03.06.2005	03.06.2020	2 171 308	%	105.200	97.665	03.06. 03.12.	6.500	31.349 32.004	N
Development Bank Of Southern Africa, Midrand, Südafrika												
	ZAR	50'000.00	02.03.1998	02.03.2028	849 308	%	114.800	96.099	02.03.	13.500	521.66	N
DH Switzerland Finance S.A., Luxemburg												
	CHF	5'000.00	08.12.2015	08.12.2017	30 561 433		-	100.140	08.12.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	08.12.2015	08.12.2023	30 555 764	%	101.750	100.924	08.12.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	08.12.2015	08.12.2028	30 555 803	%	106.000	101.303	08.12.	1.125	56.250	N
DirecTV Holdings LLC / DirecTV Financing Co., Inc., USA												
	USD	1'000.00	08.03.2012	15.03.2022	18 531 607	%	101.420	99.958	15.03. 15.09.	3.800	19.153 18.245	N
DNB Bank ASA, Oslo, Norwegen												
	CHF	5'000.00	18.04.2012	18.04.2018	18 314 179	%	100.710	100.641	18.04.	1.750	87.500	N
DnB Boligkreditt AS, Bergen, Norwegen												
Emissionsdisagio von 0.71% 20.1.2017 Em.preis: 99.29%	EUR	1'000.00	20.01.2010	20.01.2017	10 909 416		-	99.290	20.01. 20.01.	3.375	36.329 7.621	N
	CHF	5'000.00	24.08.2011	24.02.2017	13 463 718		-	100.789	24.02.	1.500	75.000	N
Emissionsdisagio von 0.483% 31.8.2017 Em.preis: 99.517%	EUR	1'000.00	31.08.2010	31.08.2017	11 679 723		-	99.517	31.08. 31.08.	2.375	27.135 5.518	N
	CHF	5'000.00	26.03.2010	26.03.2018	11 081 944	%	100.710	101.091	26.03.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	15.12.2010	15.12.2025	12 042 565	%	114.200	101.268	15.12.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	02.09.2010	02.09.2030	11 640 351	%	119.550	101.150	02.09.	2.000	100.00	N
Dow Chemical Company, (The), Midland, USA												
	USD	1'000.00	14.11.2012	15.11.2022	19 985 570	%	100.310	98.266	15.05. 15.11.	3.000	14.949 14.845	N
DTEK Finance Plc, London, Grossbritannien												
19.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'101.15	28.04.2015	28.03.2018	28 082 106		-	100.000	19.01.	10.375	35.600	N
Du Pont de Nemours (E.I.) & Co., Wilmington, USA												
	USD	1'000.00	28.07.2008	15.07.2018	4 450 752	%	102.140	99.958	15.01. 15.07.	6.000	30.329 28.889	N
	USD	1'000.00	20.02.2009	15.03.2019	3 730 366	%	104.030	99.646	15.03. 15.09.	5.750	28.982 27.608	N
	USD	1'000.00	09.11.2009	15.01.2020	10 720 896	%	104.540	99.585	15.01. 15.07.	4.625	23.379 22.269	N
	USD	1'000.00	23.09.2010	15.01.2021	11 782 031	%	103.370	99.859	15.01. 15.07.	3.625	18.324 17.454	N
	USD	1'000.00	25.03.2011	01.04.2021	12 749 311	%	105.530	99.789	01.04. 01.10.	4.250	21.314 20.685	N
	USD	1'000.00	15.02.2013	15.02.2023	20 711 021	%	100.020	99.965	15.02. 15.08.	2.800	14.117 13.620	N
DVB Bank SE, Frankfurt/Main, Deutschland												
	CHF	5'000.00	17.06.2015	17.06.2022	28 372 608	%	97.150	100.000	19.06.	0.575	28.750	N
DZ BANK AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank, Frankfurt A/Main, Deutschland												
	CHF	5'000.00	14.11.2012	14.11.2017	19 440 537		-	100.048	14.11.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	30.08.2013	30.08.2023	22 073 493	%	109.250	100.000	30.08.	3.238	161.90	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%	Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
DZ Bank Capital Funding Trust II, New York, USA										
Regd. Perp. 2004-without final maturity floating rate	EUR	1'000.00	22.11.2004	1 974 776	% 98.700	100.000	22.02.	VAR.	3.509	N
							22.05.		3.435	
							22.08.		3.689	
							22.11.		3.766	
DZ BANK Capital Funding Trust III, Wilmington, USA										
(no min.) 2005-without final maturity Tier 1 foating rate	EUR	1'000.00	06.06.2005	2 154 149	% 98.450	100.000	06.03.	VAR.	3.183	N
							06.06.		3.245	
							06.09.		3.404	
							06.12.		3.453	

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Eastern Power Networks PLC, London, Grossbritannien												
	GBP	1'000.00	05.07.1995	31.03.2025	378 240	%	143.200	100.730	31.03.	8.500	106.39	N
eBay Inc., San Jose, USA												
	USD	1'000.00	28.07.2014	01.08.2021	25 019 529	%	100.650	99.779	01.02. 01.08.	2.875	14.264 13.881	N
	USD	1'000.00	24.07.2012	15.07.2022	19 095 949	%	98.840	99.869	15.01. 15.07.	2.600	13.142 12.518	N
EBN B.V., Heerlen, Niederlande												
	CHF	5'000.00	04.07.2012	04.07.2019	18 584 300	%	101.600	100.900	04.07.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	27.05.2010	27.04.2020	11 226 293	%	105.750	100.714	27.04.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	22.09.2014	22.09.2022	25 322 592	%	103.000	100.652	22.09.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	03.10.2011	03.10.2023	13 659 433	%	109.650	100.318	03.10.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	04.07.2012	04.07.2024	18 584 301	%	107.700	101.198	04.07.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	22.09.2014	22.09.2026	25 322 595	%	106.000	100.128	22.09.	0.875	43.750	N
EDP Finance BV, Amsterdam, Niederlande												
Emissionsdisagio von 0.528% 21.9.2017 Em.preis: 99.472%	EUR	1'000.00	21.09.2012	21.09.2017	19 549 644		-	99.472	21.09. 21.09.	5.750	66.705 6.125	N
	USD	1'000.00	02.11.2007	02.02.2018	3 522 477	%	96.990	99.854	02.02. 02.08.	6.000	29.677 29.019	N
	CHF	5'000.00	29.11.2012	29.11.2018	19 784 155	%	103.860	100.000	29.11.	4.000	200.00	N
	EUR	1'000.00	15.04.2014	15.04.2019	24 200 879	%	103.270	99.272	15.04.	2.625	28.038	N
	USD	1'000.00	29.09.2009	01.10.2019	10 584 870	%	104.060	99.360	01.04. 01.10.	4.900	24.574 23.849	N
	EUR	1'000.00	29.06.2005	29.06.2020	2 201 575	%	109.870	99.791	29.06.	4.125	45.100	N
EFG Funding (Guernsey) Limited, St Peter Port, Guernsey												
	CHF	5'000.00	31.01.2013	31.01.2023	20 481 930	%	100.000	101.000	31.01.	4.750	237.50	N
EFG International (Guernsey) Ltd, St Peter Port, Guernsey												
13.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	13.01.2012	13.01.2022	14 756 945		-	100.000	13.01.	VAR.	85.836	N
Ekosem-Agrar GmbH, Walldorf, Deutschland	USD	1'000.00	05.04.2017	05.04.2027	36 281 877	%	103.280	100.000	05.10.	5.000	24.447	N
	EUR	1'000.00	07.12.2012	07.12.2022	19 977 377	%	94.400	100.000	07.12.	8.500	99.518	N
Eksportfinans Asa, Oslo, Norwegen												
	CHF	5'000.00	29.10.2009	29.04.2019	10 632 212	%	103.280	100.212	29.04.	2.500	125.00	N
Électricité de France SA, Paris, Frankreich	CHF	5'000.00	11.02.2011	11.02.2021	12 336 025	%	106.700	100.635	11.02.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	27.03.2009	27.03.2017	3 617 210		-	100.531	27.03.	4.000	200.00	N
	CHF	5'000.00	29.03.2010	29.09.2017	11 117 457		-	100.304	29.09.	2.250	112.50	N
	EUR	50'000.00	04.02.2008	05.02.2018	3 717 739	%	100.350	99.323	05.02.	5.000	2'672.67	N
	USD	1'000.00	26.01.2009	26.01.2019	4 996 697	%	104.250	99.688	26.01. 26.07.	6.500	32.524 31.164	N
	USD	1'000.00	26.01.2010	27.01.2020	10 955 367	%	104.450	99.564	27.01. 27.07.	4.600	22.957 22.153	N
	EUR	50'000.00	30.05.2008	29.05.2020	4 269 122	%	113.010	99.438	29.05.	5.375	2'932.46	N
	USD	1'000.00	13.10.2015	13.10.2020	30 055 583	%	99.790	99.155	13.04. 13.10.	2.350	11.806 11.449	N
	EUR	50'000.00	23.01.2009	25.01.2021	4 983 950	%	118.540	99.875	25.01.	6.250	3'363.09	N
	EUR	100'000.00	18.01.2012	18.01.2022	14 740 499	%	114.180	98.986	18.01.	3.875	4'161.68	N
	GBP	50'000.00	12.12.2008	12.12.2022	4 885 457	%	124.850	99.859	12.12.	6.875	4'545.26	N
	EUR	100'000.00	10.09.2012	10.03.2023	19 433 626	%	110.750	99.211	10.03.	2.750	2'960.37	N
	EUR	50'000.00	11.09.2009	11.09.2024	10 533 403	%	124.360	98.838	11.09.	4.625	2'630.98	N
	CHF	5'000.00	14.10.2016	14.10.2024	34 172 585	%	100.500	100.020	16.10.	0.300	15.000	N
	EUR	50'000.00	12.11.2010	12.11.2025	11 992 864	%	121.640	98.841	12.11.	4.000	2'322.40	N
	EUR	100'000.00	27.03.2012	25.03.2027	18 240 575	%	123.300	99.375	25.03.	4.125	4'366.80	N
	CHF	5'000.00	14.10.2016	13.10.2028	34 172 586	%	97.550	100.116	13.10.	0.650	32.409	N
	EUR	50'000.00	27.04.2010	26.04.2030	11 249 120	%	130.070	98.763	26.04.	4.625	2'501.77	N
	EUR	1'000.00	21.02.2003	21.02.2033	1 557 274	%	144.780	98.898	21.02.	5.625	59.999	N
	GBP	50'000.00	02.06.2009	02.06.2034	10 225 873	%	136.750	96.760	02.06.	6.125	3'802.53	N
	USD	1'000.00	26.01.2009	26.01.2039	4 996 699	%	135.750	98.551	26.01. 26.07.	6.950	34.776 33.321	N
	USD	1'000.00	26.01.2010	27.01.2040	10 955 366	%	117.760	99.124	27.01. 27.07.	5.600	27.947 26.969	N
	EUR	50'000.00	12.11.2010	12.11.2040	11 993 073	%	131.050	99.837	12.11.	4.500	2'612.70	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Elia System Operator SA/NV, Bruxelles, Belgien												
	EUR	1'000.00	13.05.2004	13.05.2019	1 852 030	%	107.100	99.806	13.05.	5.250	57.442	N
ELM BV, Amsterdam, Niederlande												
Euro Medium-Term Notes 2007-Without Fixed Maturity VRN on Swiss Life Ins&Pen MP	EUR	50'000.00	12.04.2007	26.04.2017	3 040 359		-	100.000	12.04.	5.849	3'164.37	N
13.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung									13.04.		8.673	
Emirates NBD Bank PJSC, Dubai, Vereinigte Arabische Emirate												
	AUD	10'000.00	08.05.2014	08.05.2019	24 357 871	%	103.710	100.000	08.05.	5.750	210.06	N
									08.11.		222.34	
	NZD	2'000.00	08.10.2014	08.10.2019	25 591 555	%	103.980	99.664	08.10.	6.000	83.103	N
	AUD	10'000.00	18.02.2015	18.02.2022	27 128 608	%	103.760	99.033	18.02.	4.750	184.34	N
									18.08.		179.24	
Empresa Nacional del Petroleo SA ENAP, Santiago, Chile												
	CHF	5'000.00	05.12.2013	05.12.2018	22 819 924	%	102.740	100.335	05.12.	2.875	143.75	N
Enagas Financiaciones S.A.U., Madrid, Spanien												
	EUR	100'000.00	05.10.2012	05.10.2017	19 626 105		-	99.801	05.10.	4.250	4'868.58	N
Emissionsdisagio von 0.199% 5.10.2017 Em.preis: 99.801%									05.10.		227.96	
ENBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, Karlsruhe, Deutschland												
	EUR	1'000.00	18.03.2014	02.04.2076	23 943 239	%	107.480	99.236	02.04.	3.625	38.733	N
EnBW International Finance BV, Amersfoort, Niederlande												
	CHF	5'000.00	12.07.2013	12.07.2018	21 767 760	%	100.850	100.440	12.07.	1.250	62.500	N
	EUR	50'000.00	20.11.2008	20.11.2018	4 835 836	%	106.220	99.669	20.11.	6.875	4'002.45	N
	CHF	5'000.00	12.07.2013	12.07.2023	21 767 765	%	108.950	100.634	12.07.	2.250	112.50	N
	EUR	1'000.00	09.12.2004	16.01.2025	2 013 099	%	128.510	99.270	16.01.	4.875	52.410	N
ENCE Energia y Celulosa, S.A., Madrid, Spanien												
	EUR	1'000.00	30.10.2015	01.11.2022	30 228 383	%	105.990	100.000	01.05.	5.375	29.163	N
									01.11.		31.261	
ENEL Ente Nazionale per l'Energia Elettrica S.p.A., Rom, Italien												
	EUR	1'000.00	20.02.2012	20.02.2018	18 003 070	%	100.640	99.950	20.02.	4.875	52.031	N
	EUR	1'000.00	12.06.2003	12.06.2018	1 619 931	%	102.180	99.369	12.06.	4.750	51.568	N
	EUR	5'000.00	20.05.2004	20.05.2024	1 859 606	%	128.420	98.586	20.05.	5.250	287.21	N
	EUR	1'000.00	15.01.2014	15.01.2075	23 321 062	%	108.660	99.368	15.01.	5.000	53.754	N
Enel Finance International N.V., Amsterdam, Niederlande												
	EUR	1'000.00	12.07.2011	12.07.2017	13 325 668		-	99.303	12.07.	4.125	45.418	N
Emissionsdisagio von 0.697% 12.7.2017 Em.preis: 99.303%									12.07.		7.674	
	USD	1'000.00	20.09.2007	15.09.2017	3 415 941		-	99.811	15.03.	6.250	31.502	N
									15.09.		30.009	
Emissionsdisagio von 0.189% 15.9.2017 Em.preis: 99.811%									15.09.		1.814	
	CHF	5'000.00	17.10.2012	17.12.2018	19 575 725	%	102.980	100.251	17.12.	2.750	137.50	N
	CHF	5'000.00	23.06.2011	23.06.2020	13 107 843	%	107.350	100.964	23.06.	3.000	150.00	N
	EUR	1'000.00	12.07.2011	12.07.2021	13 326 967	%	117.090	99.477	12.07.	5.000	55.052	N
	EUR	1'000.00	17.09.2009	14.09.2022	10 553 394	%	121.800	99.207	14.09.	5.000	57.397	N
	EUR	1'000.00	15.10.2012	17.04.2023	19 783 104	%	123.020	98.899	17.04.	4.875	52.072	N
	EUR	1'000.00	29.09.2003	29.09.2023	1 683 479	%	126.470	98.760	29.09.	5.250	60.052	N
	GBP	1'000.00	17.09.2009	14.08.2024	10 553 523	%	121.700	98.800	14.08.	5.625	70.864	N
	CHF	5'000.00	03.03.2017	03.09.2024	35 342 806	%	101.800	100.120	03.09.	0.550	13.750	N
	CHF	5'000.00	26.10.2012	26.10.2027	19 841 507	%	128.550	101.296	26.10.	4.000	200.00	N
Energa Finance AB, Stockholm, Schweden												
	EUR	1'000.00	19.03.2013	19.03.2020	20 972 563	%	106.800	99.704	19.03.	3.250	34.831	N
Energie AG Oberoesterreich OKA, Linz, Österreich												
	EUR	1'000.00	04.03.2005	04.03.2025	2 081 230	%	124.630	99.211	04.03.	4.500	48.228	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Energiekontor Finanzierungsdienst GmbH & Co.KG, Bremen, Deutschland												
31.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	405.75	24.12.2009	01.04.2020	11 048 364	%	101.100	100.000	31.03.	6.500	69.585	N
Enexis Holding N.V., Rosmalen, Niederlande												
	EUR	1'000.00	26.01.2012	26.01.2022	14 814 436	%	112.670	99.043	26.01.	3.375	36.131	N
Engie SA, Paris, Frankreich												
(no min/no max) 2014-Without Fixed Maturity Subord.Floating Rate	EUR	100'000.00	02.06.2014		24 534 105	%	103.330	99.430	02.06.	3.000	3'260.25	N
Emissionsdisagio von 0.296% 20.7.2017 Em.preis: 99.704%	EUR	1'000.00	20.07.2012	20.07.2017	19 027 328		-	99.704	20.07. 20.07.	1.500	16.602 3.276	N
Emissionsdisagio von 0.648% 10.10.2017 Em.preis: 99.352%	USD	1'000.00	10.10.2012	10.10.2017	19 736 378		-	99.352	10.04. 10.10. 10.10.	1.625	8.190 7.915 6.313	N
Emissionsdisagio von 0.608% 18.10.2017 Em.preis: 99.392%	EUR	1'000.00	18.10.2010	18.10.2017	11 876 866		-	99.392	18.10. 18.10.	2.750	31.794 7.029	N
	CHF	5'000.00	20.10.2011	20.10.2017	13 975 685		-	100.244	20.10.	1.500	75.000	N
15.3.2017 Rückkauf ausstehender Titel zu 104.86%	EUR	1'000.00	19.02.2003	19.02.2018	1 553 473	%	100.580	98.978	20.02.	5.125	54.849	N
	EUR	1'000.00	01.06.2012	01.06.2018	18 666 777	%	100.970	99.739	01.06.	2.250	24.485	N
	EUR	100'000.00	21.11.2011	21.01.2020	14 297 919	%	106.350	99.593	21.01.	3.125	3'363.09	N
	CHF	5'000.00	09.10.2012	09.10.2020	19 528 810	%	103.550	100.345	09.10.	1.125	56.250	N
	EUR	1'000.00	16.01.2009	18.01.2021	4 958 728	%	119.110	99.646	18.01.	6.375	68.466	N
	EUR	1'000.00	20.07.2012	20.07.2022	19 027 336	%	110.560	98.997	20.07.	2.625	29.053	N
	USD	1'000.00	10.10.2012	10.10.2022	19 736 374	%	100.370	98.799	10.04. 10.10.	2.875	14.490 14.004	N
15.3.2017 Rückkauf ausstehender Titel zu 104.86%	EUR	1'000.00	18.10.2010	18.10.2022	11 876 878	%	115.010	99.499	18.10.	3.500	40.465	N
15.3.2017 Rückkauf ausstehender Titel zu 104.86%	EUR	1'000.00	01.06.2012	01.02.2023	18 666 787	%	112.940	98.580	01.02.	3.000	32.117	N
	CHF	5'000.00	09.10.2012	09.10.2024	19 528 819	%	109.150	100.484	09.10.	1.625	81.024	N
Eni S.p.A., Rom, Italien												
Emissionsdisagio von 0.29% 11.10.2017 Em.preis: 99.71%	EUR	1'000.00	11.10.2011	11.10.2017	13 866 014		-	99.710	11.10. 11.10.	4.875	56.152 3.340	N
Ensco PLC, London, Grossbritannien	EUR	1'000.00	11.10.2011	11.10.2017	14 065 340		-	100.000	11.04. 11.10.	VAR.	14.041 14.985	N
	USD	1'000.00	17.03.2011	15.03.2021	12 663 044	%	96.840	98.025	15.03. 15.09.	4.700	23.690 22.566	N
Entwicklungsbank des Europarates, Strassburg, Frankreich												
	AUD	1'000.00	08.10.2010	08.10.2020	11 827 623	%	109.370	99.296	08.04. 08.10.	6.000	22.615 22.875	N
	CHF	5'000.00	06.05.2008	06.11.2020	3 926 651	%	111.050	101.110	06.11.	3.375	168.75	N
	CHF	5'000.00	06.03.2014	06.03.2023	23 680 399	%	106.400	100.067	06.03.	1.000	50.000	N
E.ON International Finance BV, Venlo, Niederlande												
Emissionsdisagio von 0.166% 29.5.2017 Em.preis: 99.834%	EUR	1'000.00	29.05.2002	29.05.2017	1 426 097		-	99.834	29.05. 29.05.	6.375	69.560 1.811	N
Emissionsdisagio von 0.368%	EUR	1'000.00	02.10.2007	02.10.2017	3 426 726		-	99.632	02.10. 02.10.	5.500	62.834 4.204	N
	USD	1'000.00	22.04.2008	30.04.2018	3 968 947	%	101.080	99.578	30.04. 30.10.	5.800	28.824 28.912	N
	GBP	50'000.00	30.10.2007	30.10.2019	3 497 983	%	108.960	99.352	30.10.	6.000	3'946.38	N
	EUR	1'000.00	07.05.2008	07.05.2020	3 987 919	%	113.310	99.281	07.05.	5.750	62.695	N
Ericsson (Telefonaktiebolaget LM), Stockholm, Schweden												
Emissionsdisagio von 0.424% 27.6.2017 Em.preis: 99.576%	EUR	1'000.00	27.06.2007	27.06.2017	3 216 013		-	99.576	27.06. 27.06.	5.375	58.536 4.617	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Erste Group Bank AG, Wien, Österreich												
	CHF	5'000.00	10.07.2007	10.07.2017	3 181 024		-	100.965	10.07.	3.250	162.50	N
	AUD	1'000.00	15.10.2013	15.05.2019	22 490 230	%	102.390	100.000	15.05.	4.750	37.346	N
	EUR	1'000.00	03.01.2014	04.01.2021	23 235 353	%	103.000	100.000	03.01. 03.04. 03.07. 03.10.	VAR.	4.095 4.006 4.151 4.388	N
	EUR	1'000.00	08.10.2012	10.10.2022	19 722 604	%	129.670	99.782	10.10.	7.125	82.023	N
	CHF	5'000.00	09.09.2011	09.09.2026	13 599 863	%	102.950	101.530	11.09.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	14.10.2010	14.10.2030	11 794 064	%	101.850	100.552	14.10.	2.250	112.50	N
Eskom Holdings SOC Limited, Südafrika												
	ZAR	1'000.00	01.07.1992	01.08.2021	843 287	%	105.000	84.991	01.02. 01.08.	13.500	5.024 4.876	N
	ZAR	5'000.00	18.08.1997	18.08.2027	679 222	%	30.560	2.575		0.000	0.000	Y
	ZAR	50'000.00	08.09.1997	31.12.2032	695 883	%	14.700	2.140		0.000	0.000	Y
Essity AB, Stockholm, Schweden												
	EUR	1'000.00	10.06.2013	09.06.2023	21 566 006	%	109.500	99.043	09.06.	2.500	27.127	N
Eurasian Development Bank, Almaty, Kasachstan												
	RUB	100'000.00	05.10.2012	05.10.2017	19 714 488		-	100.000	05.04. 05.10.	8.000	71.500 68.076	N
	USD	1'000.00	26.09.2013	26.09.2020	22 418 453	%	105.420	98.310	27.03. 26.09.	5.000	24.584 24.268	N
European Bank For Reconstruction & Development EBRD, London, Grossbritannien												
	ZAR	5'000.00	07.04.1997	07.04.2017	608 630		-	100.000		0.000	0.000	Y
	NOK	10'000.00	11.05.2010	11.05.2017	11 263 419		-	100.683	11.05.	4.000	46.876	N
	RUB	50'000.00	12.05.2010	12.05.2017	11 260 620		-	100.525	12.05.	6.750	59.163	N
	RUB	10'000.00	27.06.2012	27.06.2017	18 858 628		-	100.000	27.06.	6.500	10.639	N
Tranche 6	ZAR	5'000.00	05.01.1998	31.12.2018	796 649	%	93.160	7.350		0.000	0.000	Y
	ZAR	50'000.00	03.04.1998	31.12.2020	860 475	%	80.480	7.170		0.000	0.000	Y
	ZAR	5'000.00	17.06.1997	17.06.2027	644 252	%	47.000	3.300		0.000	0.000	Y
	ZAR	50'000.00	22.10.1997	30.12.2027	718 241	%	45.000	3.310		0.000	0.000	Y
	ZAR	50'000.00	05.01.1998	29.12.2028	797 537	%	40.910	2.900		0.000	0.000	Y
	ZAR	50'000.00	02.03.1998	31.12.2029	848 058	%	37.040	3.050		0.000	0.000	Y
European Financial Stability Facility, Luxemburg												
	EUR	1'000.00	05.02.2013	05.02.2018	20 590 151	%	100.150	99.539	05.02.	1.250	13.363	N
Tranche 3 Reg S	EUR	1'000.00	02.05.2012	02.05.2019	18 477 734	%	104.170	99.817	02.05.	2.625	28.441	N
	EUR	1'000.00	22.06.2011	05.07.2021	13 209 284	%	112.660	99.013	05.07.	3.375	36.934	N
European Union, Brussels, Europäische Währungsunion	EUR	1'000.00	14.11.2011	04.02.2022	14 287 677	%	115.190	99.216	04.02.	3.500	37.416	N
Emissionsdisagio von 0.127% 22.9.2017 Em.preis: 99.873%	EUR	1'000.00	22.09.2010	22.09.2017	11 768 568		-	99.873	22.09. 22.09.	2.375	27.541 1.472	N
	EUR	1'000.00	24.03.2011	04.04.2018	12 726 862	%	100.960	99.955	04.04.	3.250	34.708	N
	EUR	1'000.00	11.03.2010	10.05.2019	11 092 670	%	105.290	99.227	10.05.	3.375	36.991	N
Eutelsat S.A., Paris, Frankreich	EUR	1'000.00	29.09.2011	04.09.2026	13 953 983	%	122.250	99.351	04.09.	3.000	34.168	N
	EUR	100'000.00	13.12.2013	13.01.2020	23 105 507	%	104.310	99.289	13.01.	2.625	2'824.21	N
Evonik Industries AG, Essen, Deutschland												
	EUR	1'000.00	08.04.2013	08.04.2020	21 044 223	%	104.220	99.185	08.04.	1.875	20.033	N
	EUR	1'000.00	23.01.2015	23.01.2023	26 718 799	%	102.800	99.337	23.01.	1.000	10.761	N
EWE AG, Oldenburg, Deutschland												
	EUR	1'000.00	14.10.2004	14.10.2019	1 963 049	%	108.780	99.791	14.10.	4.875	56.084	N
Export Development Canada, Ottawa, Kanada												
	CHF	5'000.00	24.06.2009	24.07.2017	10 230 738		-	100.556	24.07.	2.625	131.25	N
Export-Import Bank Of India, London, Grossbritannien												
	AUD	1'000.00	05.04.2013	05.04.2018	21 043 494	%	100.560	100.000	05.04.	5.760	43.832	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
FBG Finance Pty Ltd, Southbank, Australien												
	AUD	10'000.00	09.12.2016	07.08.2020	34 961 784	%	102.515	100.000	07.02. 07.08.	3.750	144.05 142.98	N
	AUD	10'000.00	06.09.2017	06.09.2022	38 035 775	%	100.300	99.726		3.250	0.000	N
	AUD	10'000.00	06.09.2017	06.09.2027	38 035 806	%	101.590	99.231		4.100	0.000	N
FBG Treasury (Australia) Ltd, Australien												
	AUD	10'000.00	07.08.2015	07.08.2020	29 126 648	%	101.050	99.944	07.02. 07.08.	3.750	144.05 142.98	N
FCA Bank S.p.A - Irish branch, Dublin, Irland												
	EUR	1'000.00	17.04.2014	17.04.2019	24 218 683	%	103.350	99.502	17.04.	2.625	28.038	N
FCE Bank PLC, Grossbritannien												
	EUR	1'000.00	21.05.2013	21.05.2018	21 412 302	%	100.750	99.456	21.05.	1.750	19.147	N
Federative Republic of Brazil, Brasilia, Brasilien												
	USD	1'000.00	26.01.2000	15.01.2020	1 039 090	%	121.170	96.394	15.01. 15.07.	12.750	64.450 61.390	N
	USD	1'000.00	22.03.2001	15.04.2024	1 210 349	%	127.560	70.500	15.04. 15.10.	8.875	44.447 43.272	N
	USD	1'000.00	07.08.2003	15.04.2024	1 651 219	%	127.840	90.485	15.04. 15.10.	8.875	44.447 43.272	N
	USD	1'000.00	01.11.2013	07.01.2025	22 699 871	%	101.710	99.521	07.01. 07.07.	4.250	21.602 20.495	N
	USD	1'000.00	17.03.2016	07.04.2026	31 897 242	%	111.350	99.066	07.04. 07.10.	6.000	30.202 29.387	N
	USD	1'000.00	09.06.1997	15.05.2027	656 931	%	143.750	93.234	15.05. 15.11.	10.125	50.454 50.103	N
	USD	1'000.00	06.03.2000	06.03.2030	1 053 919	%	165.350	98.250	06.03. 06.09.	12.250	61.940 58.417	N
	USD	1'000.00	20.01.2004	20.01.2034	1 767 060	%	131.720	94.723	20.01. 20.07.	8.250	41.468 39.243	N
Fedex Corporation, Memphis, USA												
	USD	1'000.00	09.01.2015	01.02.2020	26 605 254	%	99.980	99.819	01.02. 01.08.	2.300	11.411 11.105	N
Ferratum Capital Germany GmbH, Berlin, Deutschland												
	EUR	1'000.00	21.10.2013	21.10.2018	22 506 738	%	104.300	100.000	21.10.	8.000	92.628	N
Ferrovial Emisiones SA, Madrid, Spanien												
	EUR	100'000.00	14.09.2016	14.09.2022	33 891 470	%	99.280	99.799	14.09.	0.375	430.48	N
FF GROUP FINANCE LUXEMBOURG II S.A., Luxemburg												
	CHF	5'000.00	02.11.2017	02.11.2021	38 551 805	%	98.900	100.000		3.250	0.000	N
Fiat Chrysler Automobiles N.V., Amsterdam, Niederlande												
	USD	1'000.00	14.04.2015	15.04.2020	28 318 728	%	99.310	100.000	15.04. 15.10.	4.500	22.536 21.941	N
	EUR	1'000.00	30.03.2016	29.03.2024	32 046 532	%	109.270	100.000	29.03.	3.750	40.084	N
Fiat Chrysler Finance Europe S.A., Luxemburg												
	CHF	5'000.00	22.11.2013	22.11.2017	22 517 330		-	100.000	22.11.	4.000	200.00	N
	EUR	1'000.00	15.03.2013	15.03.2018	20 944 389	%	101.210	100.000	15.03.	6.625	70.996	N
	CHF	5'000.00	30.09.2014	30.09.2019	25 428 162	%	104.650	100.000	30.09.	3.125	156.25	N
	EUR	1'000.00	21.03.2014	22.03.2021	24 009 446	%	110.780	100.000	22.03.	4.750	50.784	N
	EUR	1'000.00	15.07.2014	15.07.2022	24 923 432	%	112.870	100.000	15.07.	4.750	52.470	N
Fiat Chrysler Finance North America Inc, New York, USA												
	EUR	50'000.00	12.06.2007	12.06.2017	3 184 315		-	99.232	12.06. 12.06.	5.625	3'053.39 416.88	N
Emissionsdisagio von 0.768% 12.6.2017 Em.preis: 99.232%												
Financiere Quick SAS, Frankreich												
	EUR	935.48	08.04.2014	15.10.2019	24 161 323		-	100.000	17.01. 18.04. 18.04.	VAR.	18.428 18.122 9.994	N
Rückzahlungsagio von 1% 18.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung												

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Finnvera Oyj, Kuopio, Finnland												
	USD	1'000.00	07.11.2012	07.11.2017	19 954 346		-	99.754	07.11.	1.000	9.989	N
Emissionsdisagio von 0.246% 7.11.2017 Em.preis: 99.754%									07.11.		2.457	
First Abu Dhabi Bank P.J.S.C., Abu Dhabi, Vereinigte Arabische Emirate												
	AUD	10'000.00	07.03.2013	07.03.2018	20 830 731	%	100.870	99.607	07.03.	5.000	190.92	N
									07.09.		192.95	
	AUD	10'000.00	19.03.2014	19.03.2019	23 947 393	%	102.030	99.375	19.03.	4.750	181.53	N
									19.09.		184.45	
First Gulf Bank, Abu Dhabi, Vereinigte Arabische Emirate												
	AUD	10'000.00	01.04.2014	01.04.2019	24 065 434	%	102.610	98.945	01.04.	5.000	190.04	N
									01.10.		190.96	
	USD	1'000.00	24.02.2015	24.02.2020	27 201 108	%	99.590	99.549	24.02.	2.625	13.212	N
									24.08.		12.660	
	CHF	5'000.00	27.05.2015	27.05.2022	27 887 594	%	101.600	100.359	27.05.	0.625	31.250	N
Firstgroup PLC, Aberdeen, Grossbritannien												
	GBP	1'000.00	19.09.2008	19.09.2018	4 574 738	%	104.950	99.332	19.09.	8.125	105.78	N
FirstRand Bank Ltd, Südafrika												
	CHF	5'000.00	28.05.2014	28.05.2019	23 831 568	%	101.020	100.215	28.05.	2.000	100.00	N
FMC FINANCE VII SA, Luxemburg												
	EUR	1'000.00	03.02.2011	15.02.2021	12 414 129	%	114.980	100.000	15.02.	5.250	27.989	N
									15.08.		29.926	
FMC Finance VIII SA, Luxemburg												
	EUR	1'000.00	14.09.2011	15.09.2018	13 837 634	%	104.620	98.623	15.03.	6.500	34.828	N
									15.09.		37.337	
	EUR	1'000.00	26.01.2012	31.07.2019	14 799 546	%	108.210	100.000	31.01.	5.250	27.987	N
									31.07.		29.862	
FMO-Nederlandse Financierings-Maatschappij Voor Ontwikkelingslanden NV, The Hague, Niederlande												
	NZD	2'000.00	16.10.2014	16.10.2019	25 686 726	%	103.540	101.075	16.10.	4.750	66.526	N
FMS Wertmanagement, Eindhoven, Deutschland												
	EUR	100'000.00	17.06.2011	17.06.2021	13 192 807	%	112.370	98.804	17.06.	3.375	3'670.81	N
Fondo Mivivienda SA, Peru												
	CHF	5'000.00	13.06.2014	13.06.2018	24 483 044	%	100.730	100.276	13.06.	1.250	62.500	N
Fonterra Co-operative Group Ltd, Auckland, Neuseeland												
	CNY	1'000'000.00	29.01.2014	29.01.2019	23 469 118	%	99.130	100.000	29.01.	3.600	2'630.99	N
									29.07.		2'559.87	
Ford Motor Credit Company, Dearborn, USA												
	AUD	2'000.00	10.12.2015	10.12.2018	30 670 254	%	101.290	100.000	10.06.	4.050	29.527	N
									10.12.		30.341	
	AUD	2'000.00	02.06.2016	02.06.2020	32 700 110	%	101.180	100.000	02.06.	3.588	25.651	N
									02.12.		26.910	
Fortum Corporation, Espoo, Finnland												
	EUR	1'000.00	24.05.2011	24.05.2021	13 053 557	%	112.020	99.008	24.05.	4.000	43.694	N
Franz Haniel & Cie. GMBH, Duisburg, Deutschland												
Notes Variable Rate on Rating Reg-S Series 5	EUR	1'000.00	01.02.2010	01.02.2017	10 951 625		-	99.530	01.02.	VAR.	62.724	N
Emissionsdisagio von 0.47% 1.2.2017 Em.preis: 99.53%									01.02.		5.017	
	EUR	1'000.00	08.02.2012	08.02.2018	14 916 990	%	100.480	99.635	08.02.	VAR.	66.478	N
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide, Frankfurt am Main, Deutschland												
	EUR	1'000.00	10.09.2009	10.09.2019	10 518 171	%	108.700	99.832	10.09.	5.250	59.894	N
Freeport-McMoRan Inc., Phoenix, USA												
	USD	1'000.00	15.09.2013	15.03.2018	20 856 621	%	98.750	99.990	15.03.	2.375	11.971	N
									15.09.		11.403	
	USD	1'000.00	13.02.2012	01.03.2022	14 970 395	%	98.440	99.747	01.03.	3.550	17.908	N
									01.09.		17.086	

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Freistaat Bayern, Deutschland												
	EUR	1'000.00	16.01.2007	16.01.2017	2 871 067		-	99.992	16.01. 16.01.	4.125	44.347 0.08577	N
Emissionsdisagio von 0.008% 16.1.2017 Em.preis: 99.992%												
	EUR	1'000.00	17.01.2011	17.01.2018	12 299 319	%	100.020	99.623	17.01.	2.750	29.567	N
	EUR	1'000.00	24.03.2010	24.03.2020	11 162 093	%	108.100	99.079	24.03.	3.250	34.809	N
	EUR	1'000.00	08.09.2010	08.09.2020	11 714 655	%	107.180	99.517	08.09.	2.375	27.057	N
Fresenius SE & Co. KGaA, Bad Homburg v. d. Höhe, Deutschland												
	EUR	1'000.00	23.01.2014	01.02.2019	23 338 317	%	102.560	99.647	01.02. 01.08.	2.375	12.678 13.542	N
	EUR	1'000.00	28.03.2012	15.04.2019	18 252 546	%	105.400	100.000	15.04. 15.10.	4.250	22.698 24.447	N
	EUR	1'000.00	24.01.2013	15.07.2020	20 444 777	%	106.940	100.000	15.01. 15.07.	2.875	15.412 15.879	N
	EUR	1'000.00	23.01.2014	01.02.2021	23 338 301	%	108.330	98.751	01.02. 01.08.	3.000	16.014 17.106	N
	EUR	1'000.00	11.02.2014	01.02.2024	23 576 392	%	116.980	100.000	01.02. 01.08.	4.000	21.353 22.809	N
Futuren SA, Aix en Provence, Frankreich												
	EUR	19.03	31.10.2007	01.01.2041	3 509 159	CHF	9.120	109.301	01.01. 01.07.	3.922	0.39871 0.37645	N
fv Europe III Aktiengesellschaft, Vaduz, Liechtenstein												
	EUR	100.00	16.09.2013	16.09.2023	22 374 532	%	100.000	100.000	01.06.	VAR.	3.672	N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Gas Natural Capital Markets, SA, Barcelona, Spanien												
Emissionsdisagio von 0.348% 9.2.2017 Em.preis: 99.652%	EUR	100'000.00	09.02.2011	09.02.2017	12 411 404		-	99.652	09.02. 09.02.	5.625	6'019.72 371.40	N
Emissionsdisagio von 0.229% 24.4.2017 Em.preis: 99.771%	EUR	100'000.00	23.10.2012	24.04.2017	19 791 673		-	99.771	24.04. 24.04.	4.125	4'460.56 247.62	N
	EUR	50'000.00	27.01.2010	26.01.2018	10 912 695	%	100.170	99.254	27.01.	4.125	2'209.92	N
	EUR	100'000.00	13.02.2012	13.02.2018	14 891 961	%	100.490	99.413	13.02.	5.000	5'344.35	N
	EUR	100'000.00	24.05.2011	24.05.2019	13 014 239	%	107.470	99.410	24.05.	5.375	5'871.38	N
	EUR	50'000.00	09.07.2009	09.07.2019	10 303 046	%	109.700	99.381	09.07.	6.375	3'509.59	N
	EUR	50'000.00	27.01.2010	27.01.2020	10 912 825	%	108.800	99.377	27.01.	4.500	2'410.82	N
	EUR	50'000.00	02.11.2009	02.11.2021	10 667 441	%	118.770	99.430	02.11.	5.125	2'984.28	N
Gas Natural Fenosa Finance B.V., Rotterdam, Niederlande												
	CHF	5'000.00	08.02.2013	08.02.2019	20 457 491	%	102.560	100.149	08.02.	2.125	106.25	N
	EUR	100'000.00	11.04.2013	11.04.2022	21 087 419	%	114.760	99.709	11.04.	3.875	4'143.92	N
	EUR	100'000.00	17.01.2013	17.01.2023	20 434 061	%	116.350	99.139	17.01.	3.875	4'166.35	N
Gategroup Finance Luxembourg S.A., Luxemburg												
	CHF	5'000.00	28.02.2017	28.02.2022	35 394 539	%	99.000	100.000		3.000	0.000	N
Gaz Capital SA, Luxemburg												
	EUR	1'000.00	19.07.2012	15.03.2017	19 034 447		-	100.000	15.03.	3.755	40.240	N
	EUR	1'000.00	22.11.2006	22.03.2017	2 800 495		-	100.000	22.03.	5.136	54.911	N
	EUR	1'000.00	07.03.2007	02.11.2017	2 972 473		-	100.000	02.11.	5.440	63.354	N
	USD	1'000.00	11.04.2008	11.04.2018	3 931 060	%	101.290	100.000	11.04. 11.10.	8.146	40.980 39.612	N
	EUR	1'000.00	25.07.2013	25.07.2018	21 927 339	%	101.400	100.000	25.07.	3.700	40.940	N
	EUR	1'000.00	15.10.2015	15.10.2018	30 071 467	%	103.160	100.000	15.10.	4.625	53.208	N
	CHF	5'000.00	30.03.2016	30.11.2018	31 792 167	%	102.650	100.000	30.11.	3.375	168.75	N
	USD	1'000.00	23.04.2009	23.04.2019	10 130 954	%	107.830	100.000	24.04. 23.10.	9.250	46.043 45.596	N
	CHF	5'000.00	25.10.2013	25.10.2019	22 627 426	%	103.150	100.000	25.10.	2.850	142.50	N
	EUR	1'000.00	21.03.2013	20.03.2020	20 956 725	%	105.380	100.000	20.03.	3.389	36.321	N
	USD	1'000.00	23.11.2011	23.01.2021	14 345 842	%	107.230	100.000	23.01. 23.07.	5.999	29.960 28.375	N
	EUR	1'000.00	26.02.2014	26.02.2021	23 783 773	%	107.640	100.000	27.02.	3.600	38.524	N
	CHF	5'000.00	30.11.2016	30.11.2021	34 682 840	%	104.700	100.000	30.11.	2.750	137.50	N
	USD	1'000.00	19.07.2012	19.07.2022	19 034 440	%	104.500	100.000	19.01. 19.07.	4.950	25.013 23.619	N
	CHF	5'000.00	19.07.2017	19.07.2022	37 488 281	%	101.750	100.000		2.250	0.000	N
GCX Ltd, Bermuda												
	USD	1'000.00	01.08.2014	01.08.2019	25 028 195	%	86.600	100.000	01.02. 01.08.	7.000	34.731 33.798	N
GE Capital Australia Funding Pty Ltd, Burnley, Australien												
Emissionsdisagio von 0.534% 17.2.2017 Em.preis: 99.466%	AUD	1'000.00	17.02.2012	17.02.2017	14 988 397		-	99.466	17.02. 17.02.	5.750	44.246 4.097	N
Emissionsdisagio von 0.353% 20.3.2017 Em.preis: 99.647%	AUD	1'000.00	20.03.2013	20.03.2017	20 937 379		-	99.647	20.03. 20.03.	4.250	32.755 2.720	N
Emissionsdisagio von 0.25% 23.8.2017 Em.preis: 99.75%	AUD	10'000.00	23.08.2012	23.08.2017	19 303 877		-	99.750	23.02. 23.08. 23.08.	5.250	205.61 198.37 19.049	N
	AUD	10'000.00	30.01.2013	30.01.2018	20 524 546	%	100.200	99.723	30.01. 30.07.	4.500	170.96 171.89	N
	AUD	1'000.00	22.05.2013	22.05.2018	21 424 514	%	100.650	99.117	22.05.	4.000	29.124	N
	AUD	1'000.00	30.01.2014	30.07.2018	23 480 644	%	101.040	99.619	30.07.	4.125	31.775	N
	AUD	1'000.00	26.09.2013	26.09.2019	22 363 034	%	103.920	99.686	26.09.	5.000	38.219	N
	AUD	10'000.00	04.09.2013	04.09.2020	22 234 687	%	106.090	99.769	04.03. 04.09.	5.250	199.78 201.26	N
GE Capital Canada Funding Company, Mississauga, Kanada												
	CAD	1'000.00	31.05.2013	31.05.2018	21 535 584	%	100.350	99.995	31.05. 30.11.	2.420	8.643 9.248	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
GE Capital European Funding Unlimited Company, Shannon, Irland												
Emissionsdisagio von 0.403% 1.3.2017 Em.preis: 99.597%	EUR	1'000.00	01.03.2010	01.03.2017	11 066 976		-	99.597	01.03. 01.03.	4.250	45.262 4.291	N
Emissionsdisagio von 0.447% 2.5.2017 Em.preis: 99.553%	EUR	1'000.00	02.05.2013	02.05.2017	21 275 464		-	99.553	02.05. 02.05.	1.000	10.835 4.843	N
	EUR	1'000.00	15.06.2011	15.06.2017	13 079 755		-	100.000	15.06.	VAR.	3.413	N
Emissionsdisagio von 0.59% 15.6.2017 Em.preis: 99.41%	EUR	1'000.00	15.06.2011	15.06.2017	13 079 753		-	99.410	15.06. 15.06.	3.625	39.401 6.413	N
	EUR	1'000.00	16.01.2008	16.01.2018	3 681 218	%	100.080	99.712	16.01.	5.375	57.785	N
	EUR	1'000.00	15.01.2013	15.03.2018	20 423 357	%	100.250	99.913	15.03.	1.625	17.414	N
	EUR	1'000.00	18.06.2012	18.06.2019	18 816 758	%	104.450	99.713	18.06.	2.875	31.269	N
	EUR	1'000.00	23.09.2009	23.01.2020	10 580 365	%	111.210	99.320	23.01.	5.375	57.845	N
	EUR	1'000.00	22.07.2013	20.07.2020	21 901 045	%	105.560	99.636	20.07.	2.250	24.903	N
	EUR	1'000.00	17.05.2006	17.05.2021	2 556 136	%	100.430	99.698	17.02. 17.05. 17.08. 17.11.	VAR.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
	EUR	1'000.00	03.11.2006	03.11.2021	2 769 478	%	115.650	99.794	03.11.	4.350	50.549	N
	EUR	50'000.00	22.02.2007	22.02.2027	2 941 807	%	129.650	99.641	22.02.	4.625	2'473.61	N
	EUR	1'000.00	06.03.2008	01.03.2038	3 838 349	%	164.000	100.000	01.03.	6.025	64.166	N
GE Capital UK Funding Unlimited Company, Shannon, Irland												
Emissionsdisagio von 0.01% 28.9.2017 Em.preis: 99.99%	GBP	2'000.00	28.09.2010	28.09.2017	11 788 096		-	99.990	28.09. 28.09.	4.125	107.75 0.26121	N
	GBP	1'000.00	06.08.2008	06.08.2018	4 467 814	%	103.510	99.151	06.08.	6.750	85.478	N
	GBP	1'000.00	25.04.2007	25.04.2019	3 067 124	%	105.720	99.221	25.04.	5.625	71.661	N
	GBP	2'000.00	31.01.2012	31.07.2019	14 868 848	%	105.290	99.278	31.07.	4.375	111.30	N
	GBP	2'000.00	04.11.2009	04.11.2020	10 699 607	%	112.980	99.440	04.11.	5.875	154.26	N
General Electric Capital Corp, Fairfield, USA												
Emissionsdisagio von 0.382% 15.2.2017 Em.preis: 99.618%	USD	1'000.00	13.02.2007	15.02.2017	2 922 075		-	99.618	15.02. 15.02.	5.400	27.227 3.852	N
Tranche 811	USD	1'000.00	21.04.2008	01.05.2018	3 968 873	%	101.230	99.733	01.05. 01.11.	5.625	27.954 28.162	N
General Electric Company, Fairfield, USA												
Emissionsdisagio von 0.259% 1.2.2017 Em.preis: 99.741%	NZD	5'000.00	01.02.2012	01.02.2017	14 860 575		-	99.741	01.02. 01.02.	5.500	99.736 9.316	N
Emissionsdisagio von 0.423% 2.2.2017 Em.preis: 99.577%	NOK	10'000.00	02.02.2012	02.02.2017	14 848 792		-	99.577	02.02. 02.02.	3.875	46.796 5.094	N
	CHF	5'000.00	27.02.2007	27.02.2017	2 894 468		-	100.405	27.02.	2.875	143.75	N
Tranche 861 Emissionsdisagio von 0.131% 27.4.2017 Em.preis: 99.869%	USD	1'000.00	27.04.2012	27.04.2017	18 477 190		-	99.869	27.04. 27.04.	2.300	11.438 1.303	N
	PLN	200'000.00	10.05.2007	10.05.2017	3 078 117		-	100.000	10.05.	5.360	2'789.55	N
	CHF	5'000.00	19.01.2012	19.10.2017	14 679 606		-	100.293	19.10.	1.625	81.250	N
Emissionsdisagio von 0.805% 6.12.2017 Em.preis: 99.195%	USD	1'000.00	06.12.2007	06.12.2017	3 598 084		-	99.195	06.06. 06.12. 06.12.	5.250	25.294 25.981 7.967	N
Emissionsdisagio von 0.344% 15.12.2017 Em.preis: 99.656%	GBP	1'000.00	17.05.2002	15.12.2017	1 421 769		-	99.656	15.12. 15.12.	6.250	82.556 4.543	N
	SEK	1'000'000.00	16.01.2013	16.01.2018	20 436 718	%	100.120	99.778	16.01.	2.625	2'972.03	N
	NZD	5'000.00	17.01.2013	17.01.2018	20 447 827	%	100.080	99.524	17.01. 17.07.	4.250	77.203 74.358	N
	CHF	5'000.00	08.02.2006	08.02.2018	2 397 275	%	100.310	100.330	08.02.	2.500	125.00	N
	NOK	10'000.00	28.11.2012	28.02.2018	20 085 294	%	100.220	99.640	28.02.	3.000	36.047	N
Tranche 885	USD	1'000.00	02.04.2013	02.04.2018	21 034 583	%	99.940	99.709	02.04. 02.10.	1.625	8.149 7.909	N
	MXN	1'000'000.00	07.04.2008	06.04.2018	3 943 422	%	99.680	99.448	06.04. 06.10.	8.500	2'297.85 2'276.99	N
	CHF	5'000.00	19.06.2006	19.06.2018	2 563 371	%	101.910	100.850	19.06.	3.375	168.75	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	CHF	5'000.00	09.10.2008	09.10.2018	4 549 081	%	103.960	100.489	09.10.	4.500	224.37	N
Tranche 895	USD	1'000.00	14.01.2014	14.01.2019	23 321 011	%	99.960	99.812	14.01. 14.07.	2.300	11.626 11.101	N
Tranche 820	USD	1'000.00	07.08.2009	07.08.2019	10 435 985	%	105.780	99.888	07.02. 07.08.	6.000	29.924 29.172	N
	CHF	5'000.00	06.12.2004	06.12.2019	1 990 336	%	106.950	100.510	06.12.	3.125	156.25	N
Tranche 825	USD	1'000.00	08.01.2010	08.01.2020	10 886 989	%	106.100	99.658	08.01. 08.07.	5.500	27.955 26.587	N
	USD	2'000.00	28.03.2014	28.03.2020	23 943 363	%	100.000	99.760	28.03. 28.09.	2.500	24.589 24.285	N
	USD	1'000.00	16.09.2010	16.09.2020	11 756 761	%	104.830	99.217	16.03. 16.09.	4.375	21.774 21.005	N
	GBP	1'000.00	29.09.2000	29.09.2020	1 131 400	%	113.520	99.530	29.09.	6.250	81.133	N
Tranche 839	USD	1'000.00	07.01.2011	07.01.2021	12 260 485	%	105.820	99.620	07.01. 07.07.	4.625	23.508 22.303	N
Tranche 849	USD	1'000.00	17.10.2011	17.10.2021	14 093 628	%	107.020	99.786	17.04. 17.10.	4.650	23.288 22.786	N
	MXN	100'000.00	03.09.2007	03.09.2022	3 384 653	%	99.730	100.000	03.03. 03.09.	8.350	216.26 228.41	N
Tranche 528	USD	1'000.00	20.03.2002	15.03.2032	1 393 054	%	136.000	98.811	15.03. 15.09.	6.750	34.023 32.409	N
	EUR	1'000.00	19.09.2005	19.09.2035	2 272 034	%	130.740	98.650	19.09.	4.125	47.573	N
Emissionsdisagio von 0.771% 15.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	05.09.2007	15.09.2067	3 381 004		-	99.229	15.09. 15.09.	5.500	63.186 8.857	N
General Mills, Inc., Minneapolis, USA												
	USD	1'000.00	21.10.2014	21.10.2019	25 752 999	%	97.750	99.802	21.04. 21.10.	2.200	10.986 10.844	N
General Motors Financial Company, Fort Worth, USA												
	USD	1'000.00	09.05.2016	09.05.2023	32 519 834	%	101.640	99.743	09.05. 09.11.	3.700	18.599 18.467	N
German Postal Pensions Securitisation PLC, Dublin, Irland	USD	1'000.00	13.07.2015	13.07.2025	28 881 037	%	104.070	99.863	13.01. 13.07.	4.300	21.711 20.805	N
	EUR	50'000.00	23.06.2005	18.01.2021	2 191 603	%	111.100	99.773	18.01.	3.750	2'008.21	N
German Postal Pensions Securitisation 2 PLC, Dublin, Irland												
Emissionsdisagio von 0.156% 18.1.2017 Em.preis: 99.844%	EUR	50'000.00	09.06.2006	18.01.2017	2 586 501		-	99.844	18.01. 18.01.	4.250	2'275.98 83.541	N
Gerresheimer AG, Düsseldorf, Deutschland	EUR	50'000.00	09.06.2006	18.01.2022	2 586 474	%	116.940	99.048	18.01.	4.375	2'342.92	N
	EUR	1'000.00	19.05.2011	19.05.2018	13 028 202	%	101.900	99.400	19.05.	5.000	54.547	N
GetBucks Invest GMBH, Wien, Österreich												
	EUR	1'000.00	03.02.2014	03.02.2017	23 562 049		-	100.000	03.02.	11.000	117.96	N
Gindi Investments 1 Ltd, Ramat Gan, Israel												
	ILS	1.00	29.09.2015	30.06.2018	29 879 856	%	99.860	100.000	30.06. 31.12.	6.750	0.00918 0.00955	N
Glaxosmithkline Capital Inc., Wilmington, USA												
	USD	1'000.00	13.05.2008	15.05.2018	4 225 802	%	101.050	99.939	15.05. 15.11.	5.650	28.154 27.959	N
	USD	1'000.00	18.03.2013	18.03.2023	20 956 705	%	100.770	98.992	18.03. 18.09.	2.800	13.953 13.443	N
	USD	1'000.00	18.03.2013	18.03.2043	20 956 706	%	108.140	98.672	18.03. 18.09.	4.200	20.929 20.165	N
GlaxoSmithKline Capital PLC, Brentford, Grossbritannien												
Emissionsdisagio von 0.396% 13.12.2017 Em.preis: 99.604%	EUR	1'000.00	13.12.2007	13.12.2017	3 608 489		-	99.604	13.12. 13.12.	5.625	65.415 4.605	N
Tranche 3	USD	1'000.00	09.05.2012	08.05.2022	18 531 836	%	101.130	99.320	08.05. 08.11.	2.850	14.212 14.250	N
	EUR	1'000.00	02.12.2014	02.12.2024	26 210 870	%	104.660	98.856	02.12.	1.375	16.045	N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	GBP	1'000.00	19.12.2001	19.12.2033	1 342 451	%	137.320	97.906	19.06. 19.12.	5.250	32.523 34.700	N
Glaxosmithkline Capital PLC (Duplicate of GK750538), Brentford, Grossbritannien												
Tranche 2 Emissionsdisagio von 0.359% 8.5.2017 Em.preis: 99.641%	USD	1'000.00	09.05.2012	08.05.2017	18 531 841		-	99.641	08.05. 08.05.	1.500	7.480 3.580	N
Glencore Australia Holdings Pty Ltd, Australien												
	AUD	10'000.00	19.09.2014	19.09.2019	25 452 021	%	102.190	98.888	19.03. 19.09.	4.500	171.98 174.74	N
Glencore Finance Canada Ltd, York, Kanada												
Emissionsdisagio von 0.081% 15.1.2017 Em.preis: 99.919%	USD	1'000.00	10.11.2011	15.01.2017	14 269 123		-	99.919	15.01. 15.01.	3.600	18.197 0.81889	N
Emissionsdisagio von 0.464% 13.6.2017 Em.preis: 99.536%	EUR	1'000.00	13.06.2007	13.06.2017	3 187 315		-	99.536	13.06. 13.06.	5.250	56.965 5.034	N
Glencore Finance (Europe) Limited, St. Helier, Jersey												
	CHF	5'000.00	03.07.2012	03.12.2018	18 584 302	%	102.620	100.560	03.12.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	01.12.2014	01.12.2020	25 589 304	%	102.950	100.637	01.12.	1.250	62.500	N
	EUR	1'000.00	16.09.2014	18.01.2022	25 427 582	%	103.020	99.238	18.01.	1.625	17.452	N
Glencore Finance (Europe) SA, Luxemburg												
Emissionsdisagio von 0.492% 22.3.2017 Em.preis: 99.508%	EUR	50'000.00	22.03.2010	22.03.2017	11 127 626		-	99.508	22.03. 22.03.	VAR.	2'806.51 263.01	N
Euro Medium-Term Notes Variable Rate on Rating Reg-S Series 12 Senior	EUR	1'000.00	03.04.2012	03.04.2018	18 305 767	%	101.160	99.583	03.04.	VAR.	49.418	N
	GBP	50'000.00	27.02.2007	27.02.2019	2 949 246	%	106.010	98.546	27.02.	6.500	4'086.12	N
	CHF	5'000.00	23.10.2013	23.12.2019	22 571 058	%	103.950	100.625	23.12.	2.125	106.25	N
	EUR	1'000.00	01.04.2014	01.04.2021	24 075 602	%	106.230	99.448	01.04.	2.750	29.383	N
	CHF	5'000.00	10.05.2016	10.05.2021	31 941 600	%	106.600	100.000	10.05.	2.250	112.50	N
Glencore Funding LLC, Stamford, USA												
	USD	1'000.00	16.04.2015	16.04.2018	27 832 535	%	99.970	99.931	16.04. 16.10.	2.125	10.642 10.361	N
	USD	1'000.00	30.05.2013	15.01.2019	21 488 623	%	100.050	99.502	15.01. 15.07.	2.500	12.637 12.037	N
	USD	1'000.00	29.04.2014	29.04.2019	24 285 606	%	100.000	99.674	02.05. 29.10.	3.125	15.529 15.577	N
	USD	1'000.00	30.05.2013	30.05.2023	21 489 985	%	103.740	99.943	30.05. 30.11.	4.125	20.115 20.253	N
	USD	1'000.00	16.04.2015	16.04.2025	27 832 555	%	101.230	99.130	16.04. 16.10.	4.000	20.032 19.503	N
Global Bank Corp, Panama City, Panama												
	CHF	5'000.00	26.06.2014	26.11.2018	24 582 318	%	100.980	100.168	26.11.	3.000	150.00	N
Goldman Sachs Capital II, New York, USA												
Normal Automatic Pfd Enhanced Capital Secs 2007-Without Fixed Maturity Gtd Fltg Rt	USD	1'000.00	15.05.2007		3 102 401	%	88.650	100.000	01.03. 01.06. 01.09. 01.12.	VAR.	10.089 9.909 9.840 9.950	N
Goldman Sachs Group, Inc., New York, USA												
Emissionsdisagio von 0.881% 30.1.2017 Em.preis: 99.119%	EUR	50'000.00	30.01.2007	30.01.2017	2 896 526		-	99.119	30.01. 30.01.	4.500	2'405.18 469.59	N
Emissionsdisagio von 0.888% 14.2.2017 Em.preis: 99.112%	GBP	1'000.00	14.02.2002	14.02.2017	1 370 230		-	99.112	14.02. 14.02.	6.125	77.158 11.155	N
Emissionsdisagio von 0.578% 16.3.2017 Em.preis: 99.422%	EUR	50'000.00	16.03.2010	16.03.2017	11 117 819		-	99.422	16.03. 16.03.	4.375	2'337.78 308.85	N
Emissionsdisagio von 0.496% 14.5.2017 Em.preis: 99.504%	GBP	1'000.00	14.05.2007	14.05.2017	3 094 692		-	99.504	14.05. 14.05.	6.125	78.852 6.385	N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
(2.9 % min.) Regd.Floored Floater Notes Floating Rate Series F Senior	EUR	1'000.00	26.07.2012	26.07.2017	18 015 436		-	100.000	26.01.	VAR.	7.912	N
									26.04.		7.843	
									26.07.		8.175	
(2.45 % min.) Regd.Floored Floater Notes Floating Rate Series F Senior	EUR	1'000.00	30.08.2012	30.08.2017	18 644 295		-	100.000	28.02.	VAR.	6.517	N
									30.05.		6.751	
									30.08.		7.156	
(3/4 % - 1.55 %) Regd.Step Up Notes Step-Up Series F Senior	CHF	1'000.00	26.09.2012	26.09.2017	4 286 675		-	100.000	26.03.	1.550	7.750	N
									26.09.		7.750	
(1.05 % min.) Regd.Capped and Floored Floater Notes Floating Rate Series F Senior	CHF	1'000.00	27.09.2012	27.09.2017	10 216 780		-	100.000	27.03.	VAR.	2.595	N
									27.06.		2.683	
									27.09.		2.683	
	AUD	10'000.00	29.11.2012	29.11.2017	20 078 816		-	99.957	29.05.	5.250	189.16	N
									29.11.		197.32	
Emissionsdisagio von 0.043% 29.11.2017 Em.preis: 99.957%									29.11.		3.205	
Tranche 595 Fltg Rt	USD	1'000.00	16.12.2014	15.12.2017	26 407 025		-	100.000	15.03.	VAR.	5.270	N
									15.06.		5.096	
									15.09.		5.021	
									15.12.		5.315	
	CHF	5'000.00	29.11.2012	29.11.2018	20 040 417	%	101.870	100.614	29.11.	1.500	75.000	N
	USD	1'000.00	31.01.2014	31.01.2019	23 576 517	%	100.330	99.684	31.01.	2.625	12.948	N
									31.07.		12.664	
	GBP	1'000.00	05.09.2014	05.09.2019	22 316 512	%	100.120	100.000	05.03.	2.150	13.323	N
									05.09.		13.388	
	CHF	5'000.00	11.03.2014	11.09.2019	23 763 950	%	102.450	100.426	11.09.	1.250	62.500	N
	NZD	1'000.00	17.12.2014	17.12.2019	26 376 315	%	104.150	99.859	17.06.	5.200	18.291	N
									17.12.		18.009	
	CHF	5'000.00	06.02.2013	06.02.2020	20 540 901	%	103.750	100.731	06.02.	1.625	81.250	N
	EUR	1'000.00	19.08.2013	19.08.2020	22 127 812	%	105.950	99.710	19.08.	2.625	29.791	N
	USD	1'000.00	25.04.2016	25.04.2021	32 357 645	%	99.780	99.935	25.04.	2.625	13.037	N
									25.10.		12.993	
	CHF	5'000.00	09.03.2016	09.09.2021	31 142 767	%	101.950	100.190	09.09.	0.550	27.500	N
	EUR	1'000.00	12.10.2006	12.10.2021	2 732 337	%	114.800	99.589	12.10.	4.750	54.929	N
	EUR	1'000.00	18.02.2014	18.10.2021	23 701 054	%	107.980	99.088	18.10.	2.500	28.903	N
	USD	1'000.00	06.01.2017	06.01.2022	30 571 422	%	97.560	100.000	06.04.	VAR.	5.371	Y
									06.07.		5.151	
									06.10.		5.232	
	EUR	1'000.00	26.01.2015	26.07.2022	26 777 306	%	103.650	99.235	26.07.	1.375	15.334	N
	USD	1'000.00	22.01.2013	22.01.2023	20 488 358	%	102.980	99.684	22.01.	3.625	18.101	N
									22.07.		17.146	
	USD	1'000.00	27.01.2016	27.01.2023	29 047 570	%	97.990	100.000	27.01.	VAR.	6.376	N
									27.04.		6.216	
									27.07.		6.086	
									27.10.		6.385	
(2.15 % Min) Euro Medium Term Notes 2016-20.10.23 Series H Floating Rate	USD	1'000.00	21.10.2016	20.10.2023	30 571 403	%	97.010	100.000	20.01.	VAR.	5.463	N
									20.04.		5.348	
									20.07.		5.170	
									20.10.		5.403	
	CHF	5'000.00	04.09.2017	04.12.2024	37 926 867	%	101.050	100.063	04.12.	0.500	6.250	N
	GBP	1'000.00	10.04.2008	10.04.2028	3 933 321	%	141.560	99.136	10.04.	7.250	45.286	N
									10.10.		46.809	
	USD	1'000.00	13.02.2003	15.02.2033	1 557 344	%	126.000	100.000	15.02.	6.125	30.882	N
									15.08.		29.793	
Goldman Sachs International, London, Grossbritannien												
	CHF	1'000.00	01.02.2012	01.02.2017	10 216 947		-	100.000	01.02.	2.450	13.250	N
	CHF	1'000.00	23.05.2012	23.05.2017	10 473 910		-	100.000	23.05.	2.550	12.750	N
(1.5 % min. - 6 % max.) 2014-20.2.20 Floating rate	USD	1'000.00	20.02.2014	20.02.2020	22 861 287	%	98.400	100.000	20.02.	VAR.	3.841	N
									20.05.		3.607	
									20.08.		3.681	
									20.11.		3.799	
(1 % min. - 4 % max.) 2013-21.9.20 Floating rate	CHF	1'000.00	12.08.2013	21.09.2020	21 447 946	%	102.900	100.000	21.03.	VAR.	2.500	N
									21.06.		2.555	
									21.09.		2.555	
									21.12.		2.527	

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	EUR	1'000.00	10.03.2016	10.03.2028	31 498 523	%	96.150	100.000	10.03.	3.500	37.677	N
GPB Eurobond Finance PLC, Dublin, Irland												
	EUR	1'000.00	30.10.2013	30.10.2018	22 697 816	%	102.220	100.000	30.10.	3.984	46.184	N
	USD	1'000.00	04.05.2012	03.05.2019	18 510 553	%	103.900	100.000	03.05. 03.11.	7.250	35.930 36.259	N
	USD	1'000.00	05.03.2014	05.09.2019	23 824 286	%	102.450	100.000	06.03. 05.09.	4.960	25.079 23.707	N
	CHF	5'000.00	13.02.2014	13.05.2024	22 931 809	%	103.650	100.000	13.05.	5.125	256.25	N
Grand City Properties S.A., Luxemburg												
	EUR	100'000.00	02.03.2016	02.03.2022	31 725 117	%	100.240	100.000	02.03. 04.09.	VAR.	131.91 143.53	N
Grenke Finance PLC, Dublin, Irland												
	EUR	1'000.00	04.12.2015	05.10.2020	30 607 629	%	102.500	99.422	05.10.	1.375	15.751	N
Grossherzogtum Luxemburg, Luxemburg												
	EUR	1'000.00	18.05.2010	18.05.2020	11 317 735	%	108.960	99.875	18.05.	3.375	36.741	N
Groupement d'interet economique Suez Alliance, Paris, Frankreich												
	EUR	1'000.00	24.06.2003	24.06.2023	1 620 358	%	127.360	99.446	24.06.	5.750	62.505	N
GTE LLC, USA												
	USD	1'000.00	27.04.1998	15.04.2018	894 604	%	101.000	99.899	15.04. 15.10.	6.840	34.256 33.350	N
GTL Trade Finance Inc, Road Town, Britische Jungferninseln												
	USD	1'000.00	22.10.2007	20.10.2017	3 494 843		-	99.128	20.04. 20.10.	7.250	36.069 35.651	N
Emissionsdisagio von 0.872% 20.10.2017 Em.preis: 99.128%									20.10.		8.576	
GUTBURG IMMOBILIEN S.A., Luxemburg												
	CHF	5'000.00	08.07.2013	08.07.2018	21 181 638	%	101.800	100.500	08.07.	4.750	237.50	N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
H. J. Heinz Company, Pittsburgh, USA												
	USD	1'000.00	02.07.2016	02.07.2018	33 698 256	%	99.950	99.800	02.01. 02.07.	2.000	10.289 9.630	N
Halliburton Company, Houston, USA												
	USD	1'000.00	05.08.2013	01.08.2043	22 016 117	%	107.820	99.794	01.02. 01.08.	4.750	23.567 22.934	N
Hannover Finance (Luxembourg) SA, Luxemburg												
	EUR	100'000.00	20.11.2012	30.06.2043	20 036 561	%	119.680	99.778	30.06.	5.000	5'461.25	N
Hapag-Lloyd AG, Hamburg, Deutschland												
	USD	1'000.00	08.10.2010	15.10.2017	11 842 412		-	99.373		9.750		N
Emissionsdisagio von 0.6269%									17.02. 17.02.		6.275 33.075	
	EUR	1'000.00	18.07.2017	15.07.2024	37 419 421	%	105.000	100.000		5.125	0.000	N
Harley-Davidson Financial Services Inc, Illinois, USA												
	USD	1'000.00	26.02.2015	26.02.2020	27 253 517	%	99.120	99.769	26.02. 26.08.	2.150	10.810 10.266	N
HBOS plc, Edinburgh, Grossbritannien												
	EUR	1'000.00	17.03.2005	18.03.2030	2 092 964	%	116.760	98.876	18.03.	4.500	48.228	N
Tranche 7 Reg S	USD	1'000.00	30.10.2003	01.11.2033	1 708 743	%	112.790	98.807	01.05. 01.11.	6.000	29.818 30.040	N
HDTFS Incorporated, Delaware, USA												
	USD	1'000.00	16.10.2012	15.10.2020	20 798 638	%	99.730	100.000	15.04. 15.10.	5.875	29.423 28.645	N
Heathrow Finance PLC, Hounslow, Grossbritannien												
	GBP	1'000.00	14.12.2012	02.09.2019	20 219 755	%	106.210	100.000	01.03. 01.09.	5.375	33.393 33.562	N
Heathrow Funding Limited, St. Helier, Jersey												
	GBP	1'000.00	10.09.2010	10.09.2018	11 716 748	%	103.310	99.276	10.09.	6.250	78.454	N
	CHF	5'000.00	08.02.2012	08.02.2019	14 702 929		-	100.264	08.02.	2.500	125.00	N
	GBP	1'000.00	20.03.2012	20.03.2020	18 178 180	%	109.090	99.323	20.03.	6.000	73.935	N
	GBP	1'000.00	14.02.2012	14.02.2024	14 964 469	%	126.150	98.443	14.02.	7.125	89.755	N
	CHF	5'000.00	17.02.2016	17.05.2024	31 142 758	%	102.100	100.516	17.05.	0.500	25.000	N
Heckler & Koch GmbH, Oberndorf, Deutschland												
	EUR	1'000.00	12.05.2011	15.05.2018	12 996 555		-	98.750	15.05. 24.08. 24.08.	9.500	51.972 29.748 14.233	N
24.8.2017 Emissionsdisagio von 1.25% 24.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung 24.8.2017 Em.Preis von 98.75%												
HeidelbergCement AG, Heidelberg, Deutschland												
	EUR	1'000.00	03.06.2016	03.06.2024	32 715 519	%	107.600	98.963	03.06.	2.250	24.421	N
HeidelbergCement Finance Luxembourg S.A., Luxemburg												
	EUR	1'000.00	21.10.2009	31.01.2017	10 665 407		-	97.349	31.01. 31.01.	8.000	42.648 28.264	N
Emissionsdisagio von 2.651% 31.1.2017 Em.preis: 97.349%												
	CHF	5'000.00	14.11.2011	14.11.2017	14 068 451		-	100.000	15.05. 14.11.	7.250	181.75 181.25	N
	EUR	1'000.00	22.10.2007	04.01.2018	3 466 458	%	100.020	94.000	04.01.	5.625	60.487	N
	EUR	50'000.00	05.10.2011	15.12.2018	13 994 137	%	109.060	99.304	15.06. 15.12.	9.500	2'581.50 2'771.50	N
	EUR	1'000.00	19.01.2010	03.04.2020	10 912 828	%	116.490	98.219	03.04. 03.10.	7.500	40.068 42.926	N
	EUR	1'000.00	24.10.2013	21.10.2020	22 670 490	%	108.700	99.227	21.04. 21.10.	3.250	17.346 18.815	N
	EUR	1'000.00	04.04.2017	07.04.2026	36 244 704	%	102.760	99.626		1.625	0.000	N
Heineken NV, Amsterdam, Niederlande												
	USD	1'000.00	10.10.2012	01.10.2017	19 736 408		-	99.670	01.04. 24.05. 24.05. 24.05.	1.400	7.021 3.223 0.84973 2.013	N
Emissionsdisagio von 0.33% Rückzahlungsagio von 0.087%												
	EUR	1'000.00	19.03.2012	19.03.2019	18 171 652	%	102.940	99.279	19.03.	2.500	26.793	N
	EUR	1'000.00	02.08.2012	04.08.2020	19 151 068	%	105.200	99.818	04.08.	2.125	24.296	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	EUR	1'000.00	04.04.2013	06.04.2021	21 044 583	%	105.950	99.569	06.04.	2.000	21.401	N
	USD	1'000.00	03.04.2012	01.04.2022	18 329 822	%	102.790	99.731	01.04. 01.10.	3.400	17.051 16.548	N
	USD	1'000.00	10.10.2012	01.04.2023	19 736 388	%	99.950	99.811	01.04. 01.10.	2.750	13.791 13.385	N
	EUR	1'000.00	19.03.2012	19.03.2024	18 171 675	%	116.730	99.566	19.03.	3.500	37.511	N
	EUR	1'000.00	02.08.2012	04.08.2025	19 151 059	%	113.870	98.977	04.08.	2.875	32.871	N
Heinz H J Finance Company, Pittsburgh, USA												
	USD	1'000.00	07.03.2002	15.03.2032	1 388 322	%	125.350	99.336	15.03. 15.09.	6.750	34.023 32.409	N
Henkel AG & Co. KGaA, Düsseldorf, Deutschland												
	EUR	1'000.00	13.09.2016	13.09.2018	33 885 120	%	99.980	100.100	13.09.	0.000	0.000	N
	USD	2'000.00	13.09.2016	13.09.2019	33 885 122	%	98.690	99.852	13.09.	1.500	28.897	N
	USD	2'000.00	12.06.2017	12.06.2020	37 002 803	%	99.530	99.776		2.000	0.000	N
	EUR	1'000.00	13.09.2016	13.09.2021	33 885 106	%	99.760	100.000	13.09.	0.000	0.000	N
	GBP	1'000.00	13.09.2016	13.09.2022	33 885 107	%	98.830	99.586	13.09.	0.875	11.150	N
Hertz Corporation, Park Ridge, USA												
	USD	1'000.00	15.07.2011	15.01.2021	13 703 462	%	100.650	100.000	15.01. 15.07.	7.375	37.280 35.510	N
	USD	1'000.00	22.09.2016	15.10.2024	33 905 737	%	90.060	100.000	15.04. 15.10.	5.500	31.063 26.817	N
Hilti Aktiengesellschaft, Schaan, Liechtenstein												
	CHF	5'000.00	30.10.2013	30.10.2018	22 507 158	%	101.120	100.549	30.10.	0.875	43.750	N
	CHF	5'000.00	30.10.2013	30.10.2023	22 507 159	%	109.900	101.085	30.10.	1.875	93.750	N
Tranche 2024 Reg S	CHF	5'000.00	08.11.2017	08.11.2024	38 412 511	%	100.600	100.330		0.200	0.000	N
Tranche 2027 Reg S	CHF	5'000.00	08.11.2017	08.11.2027	38 412 512	%	100.450	100.171		0.400	0.000	N
Hochtief AG, Essen, Deutschland												
Emissionsdisagio von 0.532% 23.3.2017 Em.preis: 99.468%	EUR	1'000.00	23.03.2012	23.03.2017	18 223 053		-	99.468	23.03. 23.03.	5.500	58.880 5.695	N
	EUR	1'000.00	28.05.2014	28.05.2019	24 522 962	%	103.190	99.423	28.05.	2.625	28.642	N
	EUR	1'000.00	20.03.2013	20.03.2020	20 960 990	%	107.490	99.250	20.03.	3.875	41.530	N
Holcim Finance (Australia) Pty Ltd, Redland Bay, Australien												
Emissionsdisagio von 0.341% 18.7.2017 Em.preis: 99.659%	AUD	10'000.00	18.07.2012	18.07.2017	19 027 461		-	99.659	18.01. 18.07. 18.07.	6.000	229.16 224.76 25.759	N
Holcim GB Finance Ltd, Hamilton, Bermuda	AUD	10'000.00	16.06.2017	16.06.2022	37 082 066	%	101.150	99.399	16.12.	3.500	132.72	N
	GBP	1'000.00	24.04.2009	24.04.2017	10 131 347		-	100.000	24.04.	VAR.	111.29	N
Holcim Overseas Finance Ltd, Hamilton, Bermuda												
	CHF	5'000.00	10.06.2011	10.06.2021	12 825 058	%	111.100	100.658	10.06.	3.375	168.75	N
Holcim US Finance SARL & CIE SCS, Luxemburg												
	EUR	1'000.00	07.09.2012	07.09.2020	19 395 461	%	106.490	99.786	07.09.	2.625	30.028	N
HORNBACH Baumarkt AG, Bornheim, Deutschland												
	EUR	1'000.00	15.02.2013	15.02.2020	20 678 213	%	106.680	100.000	15.02.	3.875	41.430	N
HP Inc., Palo Alto, USA												
	USD	1'000.00	12.03.2012	15.09.2022	18 146 458	%	104.170	99.771	15.03. 15.09.	4.050	20.413 19.445	N
HPHT Finance (15) Ltd, Kaimaninseln												
	USD	1'000.00	17.03.2015	17.03.2018	27 504 335	%	99.950	99.787	17.03. 17.09.	2.250	11.226 10.802	N
HSBC Bank PLC, London, Grossbritannien												
	CHF	5'000.00	03.04.2007	03.04.2017	2 963 013		-	100.500	03.04.	2.750	137.50	N
Emissionsdisagio von 0.248% 15.11.2017 Em.preis: 99.752%	EUR	1'000.00	15.11.2010	15.11.2017	12 002 684		-	99.752	15.11. 15.11.	3.125	36.498 2.896	N
	CHF	5'000.00	04.04.2011	04.04.2018	12 643 426	%	100.800	100.426	04.04.	2.375	118.75	N
	CHF	5'000.00	01.04.2011	01.04.2021	12 645 371	%	108.100	100.570	01.04.	2.750	137.50	N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
HSBC Finance Corp., Prospect Heights, USA												
	GBP	1'000.00	19.08.1999	19.08.2019	866 812	%	108.260	99.576	19.08.	6.250	77.465	N
HSBC Holdings plc, London, Grossbritannien												
	USD	1'000.00	13.03.2017	13.03.2023	35 973 936	%	101.220	100.000	13.09.	3.262	15.710	N
	GBP	1'000.00	20.05.2009	20.05.2024	10 193 068	%	126.100	99.822	20.05.	6.500	82.290	N
	USD	1'000.00	13.03.2017	13.03.2028	35 975 429	%	103.940	100.000	13.09.	4.041	19.462	N
	USD	1'000.00	03.05.2006	02.05.2036	2 546 259	%	130.510	99.856	02.05. 02.11.	6.500	32.301 32.423	N
HSBC SFH (France), Frankreich												
	CHF	5'000.00	07.04.2010	07.09.2018	11 129 744	%	102.070	100.905	07.09.	2.375	118.75	N
	CHF	5'000.00	23.12.2010	23.04.2019	12 074 334	%	103.170	100.746	23.04.	2.000	100.00	N
HSH Nordbank AG, Hamburg/Kiel, Deutschland												
	EUR	1'000.00	02.05.2013	02.05.2017	21 076 686		-	100.000	02.05.	1.250	13.543	N
	EUR	1'000.00	27.04.2012	27.04.2018	18 319 180	%	99.670	100.000	27.04. 27.10.	VAR.	12.294 13.242	N
	EUR	1'000.00	14.11.2013	14.05.2018	22 575 867	%	100.490	100.000		2.015	0.000	N
	EUR	1'000.00	07.06.2013	07.12.2018	21 558 664	%	101.150	100.000		2.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	14.06.2007	14.06.2019	3 098 559	%	104.600	100.520	14.06.	3.000	150.00	N
HTM Sport GmbH, Schwechat, Österreich												
	EUR	1'000.00	26.09.2013	26.09.2018	22 243 701	%	105.700	101.000	26.09.	5.250	59.965	N
Hutchison Whampoa Europe Finance (12) Ltd, Kaimaninseln												
Emissionsdisagio von 0.394% 6.6.2017 Em.preis: 99.606%	EUR	1'000.00	06.06.2012	06.06.2017	18 737 344		-	99.606	06.06. 06.06.	2.500	27.138 4.277	N
Hutchison Whampoa Finance (CI) Limited, George Town, Kaimaninseln	EUR	1'000.00	06.06.2012	06.06.2022	18 736 559	%	113.400	99.950	06.06.	3.625	39.351	N
Emissionsdisagio von 0.103% 1.8.2017 Em.preis: 99.897%	USD	1'000.00	01.08.1997	01.08.2017	685 742		-	99.897	01.02. 01.08. 01.08.	7.450	36.964 35.970 0.99463	N
Hutchison Whampoa Finance UK PLC, London, Grossbritannien												
Emissionsdisagio von 0.453% 24.11.2017 Em.preis: 99.547%	GBP	50'000.00	24.11.2006	24.11.2017	2 799 082		-	99.547	24.11. 24.11.	5.625	3'677.04 296.12	N
Hutchison Whampoa Intl 11 Ltd, Kaimaninseln												
Emissionsdisagio von 0.481% 13.1.2017 Em.preis: 99.519%	USD	1'000.00	13.01.2012	13.01.2017	14 726 867		-	99.519	13.01. 13.01.	3.500	17.672 4.857	N
Hutchison Whampoa Intl 12 II Ltd, Kaimaninseln	USD	1'000.00	13.01.2012	13.01.2022	14 739 309	%	106.290	99.250	13.01. 13.07.	4.625	23.352 22.377	N
Emissionsdisagio von 0.232% 8.11.2017 Em.preis: 99.768%	USD	1'000.00	08.11.2012	08.11.2017	19 976 577		-	99.768	08.05. 08.11. 08.11.	2.000	9.973 10.000 2.320	N
HYPO NOE Landesbank fuer Niederoesterreich und Wien AG, Saint Poelten, Österreich	USD	1'000.00	08.11.2012	08.11.2022	19 976 585	%	101.210	99.484	08.05. 08.11.	3.250	16.207 16.250	N
	CHF	5'000.00	07.11.2006	07.02.2017	2 737 699		-	100.995	07.02.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	02.08.2005	02.08.2017	2 212 924		-	100.220	02.08.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	30.06.2017	30.12.2020	36 701 397	%	100.000	100.000	30.12.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	15.02.2017	31.03.2022	34 755 693	%	100.350	100.201		0.200	0.000	N
	CHF	5'000.00	17.10.2016	17.10.2023	34 067 777	%	100.000	100.070	17.10.	0.125	6.250	N
Hypo Vorarlberg Bank AG, Bregenz, Österreich												
	CHF	5'000.00	09.02.2006	09.08.2017	2 399 133		-	100.800	09.08.	2.375	118.75	N
	CHF	5'000.00	25.07.2013	25.07.2018	21 767 853	%	101.110	100.475	25.07.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	30.10.2009	30.10.2019	10 599 576	%	105.600	100.530	30.10.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	06.10.2016	06.10.2021	33 833 044	%	100.150	100.125	06.10.	0.125	6.250	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Hypotecni banka a.s., Praha, Tschechische Republik												
(no min.) 2012-19.1.17 Floating rate 19.1.2017 Em.preis: 99.4%	CZK	1.00	19.01.2012	19.01.2017	14 838 680		-	100.000		VAR.	0.000	Y
(no min.) 2012-30.8.17 Floating rate note 30.8.2017 Em.preis: 98.75%	CZK	1.00	30.08.2012	30.08.2017	19 692 766		-	100.000		VAR.	0.000	Y
Hypothekenbank Frankfurt AG, Eschborn, Deutschland												
	CHF	5'000.00	14.07.2006	14.07.2025	2 609 656	%	121.850	99.715	14.07.	3.125	156.25	N
HypoTirol Bank AG, Innsbruck, Österreich												
	CHF	5'000.00	21.03.2005	21.03.2017	2 069 909		-	100.495	21.03.	2.375	118.75	N
	CHF	5'000.00	13.02.2006	13.09.2017	2 403 045		-	100.960	13.09.	2.375	118.75	N
Hyundai Capital America Inc, Irvine, CA, USA												
	USD	1'000.00	08.12.2011	08.06.2017	14 465 565		-	99.551	08.06.	4.000	19.343	N
Emissionsdisagio von 0.449% 8.6.2017 Em.preis: 99.551%									08.06.		4.342	
	USD	1'000.00	19.03.2015	19.03.2018	27 546 891	%	99.930	99.751	19.03.	2.000	9.966	N
									19.09.		9.627	
Tranche 8 Reg S	USD	1'000.00	13.06.2016	15.06.2021	32 850 410	%	97.650	99.850	15.06.	2.450	11.941	N
									15.12.		12.150	
Hyundai Capital Services Inc, Seoul, Korea (Republik)												
	CHF	5'000.00	15.02.2012	15.02.2017	14 805 992		-	100.450	15.02.	2.500	125.00	N
	USD	1'000.00	13.03.2012	13.09.2017	18 137 464		-	99.629	13.03.	3.500	17.619	N
									13.09.		16.856	
Emissionsdisagio von 0.371% 13.9.2017 Em.preis: 99.629%									13.09.		3.573	
	CHF	5'000.00	20.10.2014	20.10.2017	25 519 170		-	100.619	20.10.	0.500	25.000	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Iberdrola Finance Ireland DAC, Dublin, Irland												
	USD	1'000.00	11.09.2009	11.09.2019	10 541 826	%	100.600	99.363	11.03. 11.09.	5.000	25.171 23.800	N
Iberdrola Finanzas S.A.U., Bilbao, Spanien												
	EUR	50'000.00	23.03.2010	23.03.2020	11 117 795	%	109.060	99.262	23.03.	4.125	2'208.00	N
Iberdrola International BV, Amsterdam, Niederlande	GBP	50'000.00	29.01.2009	29.01.2024	4 991 664	%	130.990	99.064	29.01.	7.375	4'613.83	N
	CHF	5'000.00	13.02.2012	13.02.2017	14 856 099		-	100.429	13.02.	3.000	150.00	N
Emissionsdisagio von 0.464% 21.9.2017 Em.preis: 99.536%	EUR	100'000.00	21.09.2012	21.09.2017	19 493 288		-	99.536	21.09. 21.09.	4.500	5'220.45 538.28	N
	EUR	100'000.00	11.06.2013	11.11.2020	21 532 562	%	107.850	99.464	11.11.	2.875	3'338.45	N
	EUR	100'000.00	01.02.2013	01.02.2021	20 524 513	%	110.250	99.623	01.02.	3.500	3'747.01	N
	EUR	100'000.00	15.09.2016	15.09.2025	33 904 948	%	95.220	98.946	15.09.	0.375	430.81	N
ICA Gruppen AB, Solna, Schweden												
	SEK	100'000.00	17.06.2014	17.06.2019	24 732 512	%	101.280	100.000	17.03. 19.06. 18.09. 18.12.	VAR.	30.417 32.040 33.568 32.531	N
ICICI Bank Ltd, Dubai Branch, Dubai, Vereinigte Arabische Emirate												
	CHF	5'000.00	07.01.2013	07.01.2020	20 240 644	%	104.200	100.000	07.01.	2.750	137.50	N
ICICI Bank Ltd, Manama Branch, Manama, Bahrain												
	AUD	1'000.00	03.04.2014	03.04.2019	24 104 922	%	103.210	99.665	03.04.	6.125	46.688	N
ICICI Bank UK PLC, London, Grossbritannien												
Notes 2006-Without Fixed Maturity Variable Rate Subord. 12.6.2017 Emissionsdisagio von 0.343% 12.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	100'000.00	12.12.2006	23.06.2017	2 822 298		-	99.657	12.06. 12.06.	3.813	1'868.33 332.42	N
IHO Verwaltungs GmbH, Herzogenaurach, Deutschland												
	EUR	1.00	22.09.2016	15.09.2021	33 913 833	%	102.310	100.000	15.05. 15.11.	2.750	0.01947 0.01605	N
	EUR	1.00	22.09.2016	15.09.2023	33 915 839	%	103.540	100.000	15.05. 15.11.	3.250	0.02301 0.01897	N
	EUR	1.00	22.09.2016	15.09.2026	33 915 528	%	107.120	100.000	15.05. 15.11.	3.750	0.02655 0.02189	N
IM Cedulas 5, Fondo de Titulizacion de Activos, Madrid, Spanien												
	EUR	100'000.00	15.06.2005	15.06.2020	2 185 809	%	108.650	98.630	15.06.	3.500	3'804.32	N
Imperial Brands Finance PLC, Bristol, Grossbritannien												
	EUR	1'000.00	05.07.2011	05.07.2018	13 296 375	%	102.300	99.477	05.07.	VAR.	49.245	N
Industrial And Commercial Bank of China Ltd, Sydney, Australien	GBP	1'000.00	04.12.2003	04.12.2018	1 717 400	%	104.820	99.492	04.12.	VAR.	82.955	N
	CHF	5'000.00	17.10.2014	17.12.2019	25 428 163	%	101.950	100.434	17.12.	1.000	50.000	N
Industrial Bank of Korea, Seoul, Korea (Republik)												
	AUD	10'000.00	05.03.2015	05.03.2020	27 292 956	%	100.370	99.270	05.03. 05.09.	3.250	123.67 125.60	N
INEOS Group Holdings SA, Luxemburg												
  1.3.2017 Rückzahlungsagio von 1.438% 1.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	18.02.2014	15.02.2019	23 716 929		-	100.000	15.02. 01.03. 01.03.	5.750	30.654 2.721 15.314	N
  Rückzahlungsagio von 1.469% 1.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	18.02.2014	15.02.2019	23 701 181		-	100.000	15.02. 01.03. 01.03.	5.875	29.622 2.634 14.820	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
ING Bank N.V., Amsterdam, Niederlande												
	EUR	1'000.00	13.01.2012	13.01.2017	14 710 522		-	99.757	13.01.	4.250	45.725	N
Emissionsdisagio von 0.243% 13.1.2017 Em.preis: 99.757%									13.01.		2.607	
	EUR	1'000.00	23.03.2010	23.03.2017	11 145 214		-	99.602	23.03.	3.375	36.131	N
Emissionsdisagio von 0.398% 23.3.2017 Em.preis: 99.602%									23.03.		4.260	
(1 1/10 % min.) Floored Floater Notes Floating Rate Series 4809 Senior	CHF	1'000.00	28.03.2012	28.03.2017	10 621 622		-	100.000	28.03.	VAR.	2.750	N
	AUD	2'000.00	20.11.2013	20.11.2017	22 684 067		-	100.000	20.11.	4.000	59.898	N
	EUR	1'000.00	11.01.2011	11.01.2018	12 260 169	%	99.730	99.779	11.01.	3.375	36.263	N
	NOK	10'000.00	31.05.2012	31.05.2018	18 563 978	%	100.220	100.000	31.05.	4.000	45.950	N
	AUD	1'000.00	04.06.2013	04.06.2018	21 470 973	%	101.170	101.099	04.06.	4.500	32.484	N
	EUR	1'000.00	05.06.2008	05.06.2018	4 285 479	%	102.370	99.279	05.06.	5.250	56.983	N
	CHF	5'000.00	29.11.2010	29.08.2018	12 040 132	%	101.760	100.782	29.08.	1.875	93.750	N
	CHF	5'000.00	14.03.2013	14.09.2018	20 830 929	%	101.190	100.403	14.09.	1.000	50.000	N
	EUR	1'000.00	27.05.2009	27.05.2019	10 208 166	%	107.220	99.906	27.05.	4.750	51.829	N
	EUR	1'000.00	07.06.1999	07.06.2019	805 747	%	107.370	98.431	07.06.	5.250	56.986	N
	EUR	1'000.00	18.01.2010	17.01.2020	10 912 808	%	108.850	99.418	17.01.	4.000	43.007	N
	CHF	5'000.00	23.03.2011	23.03.2021	12 651 604	%	109.000	100.880	23.03.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	17.06.2011	17.12.2021	13 174 913	%	111.300	100.711	17.12.	3.000	150.00	N
ING Bank NV, Sydney Branch, Sydney, Australien												
	AUD	5'000.00	27.11.2013	27.11.2018	22 922 256	%	102.320	99.400	27.05.	5.000	90.074	N
									27.11.		94.194	
ING Groep N.V., Amsterdam, Niederlande												
Perpetual Securities III 2004 Without fixed maturity sub.ord	EUR	100.00	16.06.2004		1 868 729	%	87.500	100.000	31.03.	VAR.	0.11776	N
									30.06.		0.18568	
									29.09.		0.19676	
									31.12.		0.18379	
7.2 % Perpetual Debt Securities 2002- Without fixed maturity Global 15.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	25.00	12.12.2002	22.04.2017	1 530 045		-	100.000	15.03.	7.200	0.45364	N
	EUR	1'000.00	31.05.2007	31.05.2017	3 133 233		-	99.626	31.05.	4.750	51.680	N
Emissionsdisagio von 0.374% 31.5.2017 Em.preis: 99.626%									31.05.		4.069	
innogy Finance BV, Hoofddorp, Niederlande												
	EUR	1'000.00	23.07.2003	23.07.2018	1 642 040	%	102.860	99.717	23.07.	5.125	56.451	N
	EUR	50'000.00	20.11.2008	31.01.2019	4 831 194	%	107.140	99.289	31.01.	6.625	3'541.46	N
	EUR	1'000.00	30.01.2013	30.01.2020	20 487 914	%	103.690	99.384	30.01.	1.875	20.043	N
	GBP	1'000.00	20.04.2001	20.04.2021	1 221 645	%	116.500	99.735	20.04.	6.500	83.056	N
	EUR	1'000.00	10.02.2009	10.08.2021	2 242 615	%	122.900	99.924	10.08.	6.500	73.615	N
	GBP	50'000.00	06.07.2009	06.07.2022	10 308 538	%	117.160	99.156	06.07.	5.500	3'428.91	N
	GBP	1'000.00	03.07.2003	06.12.2023	1 624 469	%	120.950	99.450	06.12.	5.625	74.517	N
	EUR	1'000.00	17.10.2013	17.01.2024	22 560 951	%	113.980	99.154	17.01.	3.000	32.255	N
	GBP	50'000.00	06.07.2009	06.07.2039	10 308 529	%	147.580	98.862	06.07.	6.125	3'818.56	N
innogy Finance II BV, 's-Hertogenbosch, Niederlande												
	EUR	1'000.00	14.02.2003	14.02.2033	1 553 504	%	151.290	98.670	14.02.	5.750	61.402	N
InRetail Shopping Malls, Peru												
	USD	1'000.00	09.07.2014	09.07.2021	24 850 879	%	104.100	99.309	09.01.	6.500	33.038	N
									09.07.		31.421	
Instituto De Credito Oficial, Madrid, Spanien												
	CHF	5'000.00	07.10.2009	07.11.2017	10 533 549		-	100.591	07.11.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	28.06.2007	28.06.2024	3 140 811	%	118.800	101.531	28.06.	3.250	162.50	N
Intel Corporation, Santa Clara, USA												
	USD	1'000.00	11.12.2012	15.12.2017	20 185 430		-	99.894	15.06.	1.350	6.580	N
									15.12.		6.694	
Emissionsdisagio von 0.106% 15.12.2017 Em.preis: 99.894%									15.12.		1.051	
	AUD	10'000.00	01.12.2015	01.12.2019	30 551 379	%	101.370	99.926	01.06.	3.250	116.00	N
									01.12.		121.78	
	USD	1'000.00	11.05.2017	11.05.2022	36 703 161	%	99.500	99.939	11.11.	2.350	11.697	N
	AUD	10'000.00	01.12.2015	01.12.2022	30 551 380	%	104.630	99.698	01.06.	4.000	142.77	N
									01.12.		149.88	

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	USD	1'000.00	19.09.2011	01.10.2041	13 889 549		-	99.258	01.04. 01.10.	4.800	24.073 23.362	N
Emissionsdisagio von 0.742%									29.11.		7.302	
Inter-American Development Bank IADB, Washington, USA												
	AUD	1'000.00	26.09.2012	26.09.2017	19 609 584		-	99.773	26.03. 26.09.	3.500	12.996 13.486	N
Emissionsdisagio von 0.227% 26.9.2017 Em.preis: 99.773%									26.09.		1.735	
	NZD	1'000.00	06.09.2005	15.12.2017	2 260 336		-	98.353	15.06. 15.12.	6.000	21.013 20.909	N
Emissionsdisagio von 1.647%									15.12.		11.447	
	USD	1'000.00	31.03.2003	28.03.2018	1 967 451	%	99.820	63.630	28.03. 28.09.	1.000	4.917 4.857	N
	CHF	5'000.00	15.04.2009	15.04.2019	10 068 301	%	104.520	100.508	15.04.	2.750	137.50	N
Tranche 47	USD	1'000.00	12.09.2012	12.09.2019	19 443 038	%	98.540	99.552	12.03. 12.09.	1.125	5.663 5.398	N
	NZD	1'000.00	26.07.2017	26.07.2024	37 575 075	%	101.590	99.361		3.500	0.000	N
	MXN	1'000.00	22.05.2007	05.12.2024	3 099 960	%	96.500	97.435	05.12.	7.500	3.961	N
International Bank for Reconstruction and Development (Weltbank), Washington, USA	USD	1'000.00	12.06.1995	15.06.2025	581 201	%	126.820	99.874	15.06. 15.12.	7.000	34.119 34.714	N
	AUD	1'000.00	05.03.2010	15.02.2017	11 057 544		-	100.575	15.02.	6.000	46.607	N
	ZAR	1'000.00	05.03.2010	01.03.2017	11 058 060		-	100.875	01.03.	8.750	6.767	N
	TRY	1'000.00	02.03.2010	02.03.2017	11 064 241		-	102.000	02.03.	10.000	27.292	N
Emissionsdisagio von 0.695% 7.3.2017 Em.preis: 99.305%	AUD	1'000.00	07.03.2012	07.03.2017	18 084 366		-	99.305	07.03. 07.03.	4.500	17.183 5.351	N
4.4.2017 Em.preis: 7.9%	ZAR	5'000.00	04.04.1997	04.04.2017	605 025		-	7.900		0.000	0.000	Y
Emissionsdisagio von 1.96% 9.5.2017 Em.preis: 98.04%	TRY	1'000.00	09.05.2007	09.05.2017	3 078 002		-	98.040	09.05. 09.05.	13.625	38.235 5.500	N
Emissionsdisagio von 0.322% 19.5.2017 Em.preis: 99.678%	NOK	10'000.00	02.03.2010	19.05.2017	11 060 787		-	99.678	19.05. 19.05.	3.750	43.661 3.749	N
Emissionsdisagio von 0.085% 24.5.2017 Em.preis: 99.915%	INR	50'000.00	24.11.2014	24.05.2017	26 111 922		-	99.915	24.05. 24.05.	5.000	37.697 0.64085	N
	RUB	50'000.00	05.07.2012	05.07.2017	18 899 726		-	101.584	05.07.	6.250	50.143	N
	USD	1'000.00	15.07.1987	15.07.2017	880 719		-	100.000	15.01. 15.07.	9.250	46.758 44.538	N
Emissionsdisagio von 0.546145% 13.8.2017 Em.preis: 99.453855%	NZD	1'000.00	13.08.2012	13.08.2017	19 191 147		-	99.453	13.02. 13.08. 13.08.	3.375	12.252 11.854 3.868	N
	SEK	10'000.00	22.02.2010	15.12.2017	10 999 080		-	100.097	15.12.	3.250	37.938	N
	AUD	1'000.00	24.01.2013	24.01.2018	20 468 402	%	100.090	99.727	24.01. 24.07.	3.500	13.372 13.026	N
	NZD	1'000.00	26.02.2014	26.02.2019	23 774 893	%	103.000	99.634	26.02. 26.08.	4.625	16.920 15.878	N
	RUB	100'000.00	05.03.2015	05.03.2019	27 251 879	%	103.770	100.000	05.03.	10.300	179.23	N
	CHF	5'000.00	07.05.2009	07.05.2019	10 012 838	%	104.700	100.811	07.05.	2.750	137.50	N
	EUR	1'000.00	20.05.2009	20.05.2019	10 189 709	%	106.040	99.374	20.05.	3.875	42.398	N
	RUB	50'000.00	26.07.2012	26.07.2019	19 144 588	%	100.900	101.675	26.07.	6.500	52.055	N
	AUD	1'000.00	21.10.2009	21.10.2019	10 647 002	%	106.080	98.288	21.04. 21.10.	5.750	21.540 22.184	N
	RUB	100'000.00	10.02.2015	10.02.2020	27 154 804	%	109.180	100.000	10.02. 10.08.	11.600	99.725 93.333	N
	NZD	1'000.00	10.02.2015	10.02.2020	26 943 796	%	102.700	99.589	10.02. 10.08.	3.750	13.673 13.042	N
	MXN	1'000.00	05.03.2010	05.03.2020	11 058 027	%	100.990	100.450	05.03.	7.500	3.882	N
	CAD	1'000.00	11.03.2015	11.03.2020	27 376 323	%	98.230	99.743	11.03. 11.09.	1.125	4.175 4.448	N
	AUD	1'000.00	12.03.2015	12.03.2020	27 377 423	%	100.400	99.755	12.03. 12.09.	2.500	9.463 9.717	N
	NOK	10'000.00	22.06.2010	22.06.2020	11 421 909	%	106.140	100.000	22.06.	3.625	41.538	N
	BRL	5'000.00	04.11.2015	04.11.2020	30 278 414	%	109.210	99.100	04.11.	11.750	178.86	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	NZD	1'000.00	22.01.2016	22.01.2021	31 119 524	%	102.350	99.754	22.01. 22.07.	3.500	12.727 12.205	N
	NZD	1'000.00	06.10.2014	06.10.2021	25 559 510	%	106.440	99.445	06.04. 06.10.	4.625	16.154 16.077	N
Tranche B	CHF	5'000.00	26.11.1986	26.11.2021	880 544	%	101.800	15.000		0.000	0.000	Y
	AUD	1'000.00	12.01.2017	12.01.2022	35 272 748	%	100.540	99.954	12.07.	2.800	10.274	N
	NZD	1'000.00	25.01.2017	25.01.2022	35 423 819	%	101.730	99.717	25.07.	3.375	11.788	N
	NOK	10'000.00	02.02.2017	02.02.2022	35 503 113	%	98.750	100.099		1.000	0.000	N
reine Differenzbesteuerung	ZAR	5'000.00	01.04.1997	01.04.2022	609 519	%	72.670	3.990		0.000	0.000	Y
	AUD	10'000.00	29.07.2010	29.07.2022	12 422 586	%	89.500	64.000	29.07.	0.500	38.515	Y
	ZAR	5'000.00	17.02.1998	17.02.2026	846 234	%	50.260	4.050		0.000	0.000	Y
	ZAR	5'000.00	14.07.1997	14.07.2027	659 664	%	45.020	3.150	14.07.	0.000	0.000	N
	ZAR	5'000.00	29.12.1997	29.12.2028	796 674	%	40.160	100.000		0.000	0.000	Y
	USD	1'000.00	09.02.2005	15.02.2035	2 063 859	%	127.620	98.957	15.02. 15.08.	4.750	23.949 23.105	N
International Business Machines Corporation, Armonk, USA												
Emissionsdisagio von 0.443% 6.2.2017 Em.preis: 99.557%	USD	1'000.00	06.02.2012	06.02.2017	14 916 027		-	99.557	06.02. 06.02.	1.250	6.204 4.397	N
	USD	1'000.00	15.10.2008	15.10.2018	4 680 624	%	103.620	99.628	15.04. 15.10.	7.625	38.187 37.178	N
	USD	1'000.00	11.05.2012	15.05.2019	18 574 876	%	99.700	99.850	15.05. 15.11.	1.875	9.343 9.278	N
	EUR	1'000.00	19.11.2012	19.11.2019	20 028 819	%	102.830	99.583	19.11.	1.375	16.009	N
	EUR	1'000.00	07.11.2013	06.11.2020	22 779 734	%	105.040	99.591	06.11.	1.875	21.735	N
	USD	1'000.00	01.11.2011	01.11.2021	14 217 088	%	101.520	99.065	01.05. 01.11.	2.900	14.412 14.519	N
	EUR	1'000.00	26.11.2014	26.05.2023	26 151 334	%	103.960	99.778	26.05.	1.250	13.620	N
	EUR	1'000.00	07.03.2016	07.03.2028	31 774 482	%	105.120	98.858	07.03.	1.750	18.765	N
	USD	176.47	27.11.2002	29.11.2032	1 522 870	%	125.250	97.658	29.05. 29.11.	5.875	5.060 5.101	N
International Finance Corp IFC, Washington, USA												
	CNY	10'000.00	11.03.2014	18.01.2017	23 947 245		-	100.000	18.01.	2.000	14.775	N
	TRY	1'000.00	30.01.2014	30.01.2017	23 453 955		-	100.934	30.01.	9.000	23.814	N
Emissionsdisagio von 1.115% 26.7.2017 Em.preis: 98.885%	AUD	1'000.00	26.07.2012	26.07.2017	19 071 256		-	98.885	26.01. 26.07. 26.07.	3.250	12.350 12.248 8.473	N
	NZD	1'000.00	26.02.2013	26.02.2018	20 754 976	%	100.270	99.950	26.02. 26.08.	3.875	14.176 13.303	N
	AUD	1'000.00	06.06.2013	06.06.2018	21 532 456	%	100.600	99.989	06.06. 06.12.	3.500	12.643 13.155	N
Interoil Exploration and Production ASA, Lysaker, Norwegen	RUB	100'000.00	21.01.2015	21.01.2020	26 696 735	%	108.210	99.300	21.01. 21.07.	11.000	93.175 87.293	N
	USD	1.00	28.01.2015	22.01.2020	26 827 212	%	30.000	100.000	22.01. 22.07.	6.000	0.02996 0.02838	N
Intesa Sanpaolo S.p.A., Torino/Milano, Italien												
Tier 1 Notes 2016-Without Fixed Maturity Variable Rate Reg-S	EUR	1'000.00	19.01.2016		31 098 862	%	108.010	100.000	19.01. 19.07.	7.000	37.844 38.157	N
Emissionsdisagio von 0.863% 15.6.2017 Em.preis: 99.137%	EUR	50'000.00	15.06.2007	15.06.2017	3 146 267		-	99.137	15.06. 15.06.	4.750	2'581.50 469.01	N
	EUR	1'000.00	04.11.2010	04.11.2017	11 993 166		-	100.000	04.11.	VAR.	31.879	N
	EUR	1'000.00	05.11.2012	05.11.2017	19 977 307		-	100.000	05.11.	4.000	46.370	N
	EUR	1'000.00	20.02.2006	20.02.2018	2 434 616	%	100.240	99.808	20.02. 22.05. 21.08. 20.11.	VAR.	1.447 1.443 1.488 1.533	N
	EUR	1'000.00	04.12.2012	04.12.2018	20 190 276	%	104.220	100.000	04.12.	3.100	50.178	N
	EUR	1'000.00	18.01.2013	18.01.2019	20 521 839	%	104.610	100.000	18.01.	3.700	42.422	N
	EUR	1'000.00	20.03.2015	20.03.2020	27 503 762	%	105.900	99.001	20.03.	2.750	29.473	N
	EUR	1'000.00	23.04.2015	23.04.2025	27 942 177	%	103.110	100.000	23.04.	2.855	30.872	N
	EUR	0.010	08.01.1997	08.01.2027	580 781	%	84.180	10.850		0.000	0.000	Y
	EUR	0.010	18.02.1998	18.02.2028	939 994	%	81.200	17.370		0.000	0.000	Y

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
INVESTCORP S.A., Kaimaninseln												
	CHF	5'000.00	12.06.2014	12.06.2019	24 472 532	%	103.250	100.000	12.06.	4.750	237.50	N
Irland, Irland												
	EUR	0.010	02.08.2012	18.10.2017	19 151 089		-	98.270	18.10.	5.500	0.00063	N
Emissionsdisagio von 1.73% 18.10.2017 Em.preis: 98.27%									18.10.		0.0002	
	EUR	0.010	30.06.2009	18.10.2019	10 299 331	%	111.420	99.794	18.10.	5.900	0.00068	N
	EUR	0.010	23.01.2004	18.04.2020	1 774 525	%	111.540	97.720	18.04.	4.500	0.00048	N
	EUR	0.010	14.01.2015	15.03.2022	26 625 994	%	103.800	99.537	15.03.	0.800	0.00008	N
	EUR	0.010	20.03.2013	20.03.2023	20 958 462	%	119.710	97.987	20.03.	3.900	0.00041	N
	EUR	0.010	14.01.2014	18.03.2024	23 294 596	%	119.350	98.805	18.03.	3.400	0.00036	N
Island, Island												
	ISK	1.00	26.02.2008	26.02.2019	3 824 854	%	104.850	98.973	26.02.	8.750	0.00082	N
Israel Electric Corp Ltd, Haifa, Israel												
	USD	1'000.00	10.02.2012	10.02.2017	14 964 863		-	100.000	10.02.	6.700	33.663	N
Italien, Rom, Italien												
	EUR	1'000.00	02.01.2007	01.02.2017	2 850 993		-	98.950	01.02.	4.000	21.528	N
Emissionsdisagio von 1.05% 1.2.2017 Em.preis: 98.95%									01.02.		11.210	
	EUR	1'000.00	26.02.2015	27.02.2017	27 229 664		-	99.562		0.000		Y
Emissionsdisagio von 0.438% 27.2.2017 Em.preis: 99.562%									27.02.		4.674	
	JPY	1'000'000.00	24.03.1997	24.03.2017	604 788		-	99.800	24.03.	3.450	307.91	N
Emissionsdisagio von 0.2% 24.3.2017 Em.preis: 99.8%									24.03.		17.850	
	EUR	1'000.00	15.05.2014	15.05.2017	24 422 404		-	100.250	15.05.	1.150	6.239	N
	EUR	1'000.00	01.06.2012	01.06.2017	18 700 827		-	96.400	01.06.	4.750	25.775	N
Emissionsdisagio von 3.6% 1.6.2017 Em.preis: 96.4%									01.06.		39.177	
	USD	1'000.00	12.06.2007	12.06.2017	3 185 403		-	99.367	12.06.	5.375	26.046	N
Emissionsdisagio von 0.633% 12.6.2017 Em.preis: 99.367%									12.06.		6.134	
	EUR	1'000.00	01.02.2002	01.08.2017	1 374 887		-	98.345	01.02.	5.250	28.256	N
									01.08.		29.690	
Emissionsdisagio von 1.655% 1.8.2017 Em.preis: 98.345%									01.08.		18.874	
	EUR	1'000.00	15.10.2010	15.10.2017	11 921 094		-	99.789	15.04.	VAR.	3.215	N
									15.10.		3.267	
Emissionsdisagio von 0.211% 15.10.2017 Em.preis: 99.789%									15.10.		2.427	
	EUR	1'000.00	12.11.2013	12.11.2017	22 851 952		-	100.000	12.11.	VAR.	12.448	N
	EUR	1'000.00	15.10.2014	15.01.2018	25 703 086	%	100.050	100.170	15.01.	0.750	4.053	N
									15.07.		4.108	
	CHF	5'000.00	30.01.2006	30.01.2018	2 397 040	%	100.230	100.086	30.01.	2.500	125.00	N
	EUR	1'000.00	01.08.2007	01.02.2018	3 363 953	%	100.400	99.980	01.02.	4.500	24.219	N
									01.08.		25.449	
	EUR	1'000.00	15.04.2011	15.04.2018	12 920 290	%	100.370	98.380	15.04.	VAR.	4.293	N
									15.10.		4.429	
	EUR	1'000.00	02.04.2013	01.06.2018	21 023 957	%	101.650	99.440	01.06.	3.500	18.992	N
									01.12.		20.493	
	EUR	1'000.00	01.02.2008	01.08.2018	3 987 725	%	102.920	99.190	01.02.	4.500	24.219	N
									01.08.		25.449	
	EUR	1'000.00	02.09.2013	01.12.2018	22 226 069	%	103.510	100.710	01.06.	3.500	18.992	N
									01.12.		20.493	
	EUR	1'000.00	01.09.2008	01.03.2019	4 776 608	%	105.500	94.350	01.03.	4.500	23.765	N
									01.09.		25.940	
	EUR	1'000.00	01.07.2014	01.08.2019	24 784 499	%	102.740	100.740	01.02.	1.500	8.073	N
									01.08.		8.483	
	EUR	1'000.00	01.03.2009	01.09.2019	10 150 029	%	107.360	99.200	01.03.	4.250	22.445	N
									01.09.		24.499	
	EUR	1'000.00	01.02.2004	01.02.2020	1 819 468	%	109.450	99.669	01.02.	4.500	24.219	N
									01.08.		25.449	
	EUR	1'000.00	01.09.2009	01.03.2020	10 604 940	%	109.280	101.920	01.03.	4.250	22.445	N
									01.09.		24.499	
	EUR	1'000.00	01.03.2010	01.09.2020	11 175 396	%	110.370	100.700	01.03.	4.000	21.124	N
									01.09.		23.057	
	EUR	1'000.00	01.09.2010	01.03.2021	11 687 272	%	110.980	99.830	01.03.	3.750	19.804	N
									01.09.		21.616	
	EUR	1'000.00	16.10.2013	01.05.2021	22 569 060	%	111.370	100.138	01.05.	3.750	20.179	N
									01.11.		21.989	

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	EUR	1'000.00	01.02.2006	01.08.2021	2 425 851	%	112.000	98.260	01.02. 01.08.	3.750	20.182 21.207	N
	EUR	1'000.00	01.03.2011	01.09.2021	12 566 351	%	115.850	99.730	01.03. 01.09.	4.750	25.085 27.381	N
	EUR	1'000.00	15.06.2014	15.12.2021	24 665 263	%	106.470	100.270	15.06. 15.12.	2.150	11.652 12.579	N
	EUR	1'000.00	01.09.2011	01.03.2022	13 718 457	%	118.240	98.750	01.03. 01.09.	5.000	26.406 28.822	N
	EUR	1'000.00	15.12.2014	15.06.2022	27 699 771	%	101.010	100.130	15.06. 15.12.	VAR.	1.826 1.657	N
	EUR	1'000.00	01.05.2012	01.11.2022	19 376 623	%	122.390	98.200	01.05. 01.11.	5.500	29.596 32.250	N
	EUR	1'000.00	15.06.2015	15.12.2022	29 863 664	%	101.350	99.930	15.06. 15.12.	VAR.	2.652 2.555	N
	EUR	1'000.00	01.03.2013	01.05.2023	20 795 346	%	118.260	97.810	01.05. 01.11.	4.500	24.215 26.387	N
	EUR	1'000.00	15.01.2016	15.07.2023	32 386 557	%	100.850	100.380	15.01. 15.07.	VAR.	2.787 2.584	N
	EUR	1'000.00	01.02.2008	01.08.2023	3 952 035	%	120.470	99.135	01.02. 01.08.	4.750	25.565 26.863	N
	USD	1'000.00	27.09.1993	27.09.2023	117 802	%	118.400	98.725	27.03. 27.09.	6.875	33.803 33.506	N
	EUR	0.010	01.11.1993	01.11.2023	144 193	%	144.570	93.750	01.05. 01.11.	9.000	0.00048 0.00052	N
	EUR	0.010	22.12.1993	22.12.2023	168 561	%	143.220	92.500	22.06. 22.12.	8.500	0.00045 0.00049	N
	EUR	1'000.00	01.08.2013	01.03.2024	21 990 050	%	119.320	100.770	01.03. 01.09.	4.500	23.765 25.940	N
	EUR	1'000.00	01.03.2009	01.03.2025	10 346 171	%	124.110	99.014	01.03. 01.09.	5.000	26.406 28.822	N
	EUR	1'000.00	02.03.2015	01.06.2025	27 253 764	%	99.640	101.400	01.06. 01.12.	1.500	8.139 8.782	N
	EUR	1'000.00	01.09.2010	01.03.2026	11 796 702	%	121.520	100.070	01.03. 01.09.	4.500	23.765 25.940	N
	EUR	1'000.00	01.03.2016	01.06.2026	31 713 254	%	98.570	100.970	01.06. 01.12.	1.600	8.682 9.368	N
	EUR	0.010	01.11.1996	01.11.2026	581 560	%	144.680	99.450	01.05. 01.11.	7.250	0.00039 0.00042	N
	EUR	0.010	01.11.1997	01.11.2027	790 643	%	140.450	100.150	01.05. 01.11.	6.500	0.00034 0.00038	N
	EUR	1'000.00	22.01.2013	01.09.2028	20 479 017	%	125.020	100.017	01.03. 01.09.	4.750	25.085 27.381	N
	EUR	0.010	01.11.1998	01.11.2029	973 619	%	131.100	99.700	01.05. 01.11.	5.250	0.00028 0.0003	N
	EUR	1'000.00	01.11.1999	01.05.2031	1 060 486	%	141.050	102.400	01.05. 01.11.	6.000	32.286 35.182	N
	EUR	1'000.00	01.03.2015	01.03.2032	27 580 776	%	89.300	99.501	01.03. 01.09.	1.650	8.714 9.511	N
	EUR	1'000.00	01.02.2002	01.02.2033	1 392 241	%	139.610	101.150	01.08.	5.750	32.518	N
	USD	1'000.00	27.02.2003	15.06.2033	1 565 044	%	118.910	98.436	15.06. 15.12.	5.375	26.198 26.655	N
	EUR	1'000.00	01.08.2003	01.08.2034	1 683 903	%	131.250	98.106	01.02. 01.08.	5.000	26.910 28.276	N
	EUR	1'000.00	01.08.2005	01.02.2037	2 308 521	%	117.670	101.289	01.02. 01.08.	4.000	21.528 22.621	N
	EUR	1'000.00	01.08.2007	01.08.2039	3 491 836	%	131.210	99.980	01.02. 01.08.	5.000	26.910 28.276	N
	EUR	1'000.00	01.09.2009	01.09.2040	10 543 206	%	130.770	98.186	01.03. 01.09.	5.000	26.406 28.822	N
	EUR	1'000.00	01.03.2013	01.09.2044	21 435 495	%	127.740	97.221	01.03. 01.09.	4.750	25.085 27.381	N
	EUR	1'000.00	22.01.2015	01.09.2046	26 733 248	%	102.960	99.707	01.03. 01.09.	3.250	17.164 18.734	N
Itau Unibanco Holding S.A., George Town, Kaimaninseln												
Tranche 6 Reg S	USD	1'000.00	19.03.2012	19.03.2022	18 171 465	%	104.450	100.000	19.03. 19.09.	5.650	28.155 27.198	N
Itiviti Group Holding AB, Stockholm, Schweden												
	EUR	100'000.00	27.11.2012	27.11.2017	20 070 262		-	100.000	20.04. 27.11.	8.500	4'553.02 5'990.01	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
JAB Holdings B.V., Haarlem, Niederlande												
	EUR	100'000.00	18.05.2017	22.05.2024	36 779 673	%	101.610	99.017		1.250	0.000	N
Jackson National Life Global Funding, Wilmington, USA	EUR	100'000.00	18.05.2017	18.05.2028	36 779 587	%	103.590	99.017		2.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	19.07.2017	18.07.2025	37 394 504	%	100.950	100.396		0.375	0.000	N
Japan Finance Corporation for Municipal Enterprises, Japan												
Emissionsdisagio von 0.722% 16.5.2017 Em.preis: 99.278%	USD	100'000.00	16.05.2007	16.05.2017	3 103 345		-	99.278	16.05. 16.05.	5.000	2'467.97 712.74	N
Jetpak Top Holding AB, Schweden												
	SEK	962'500.00	02.12.2016	02.12.2020	34 716 575	%	101.000	100.000	02.03. 02.06. 04.09. 04.12.	VAR.	1'785.02 1'823.10 2'007.92 1'892.03	N
John Deere Canada Funding Inc, Kanada												
	CAD	1'000.00	17.09.2015	17.09.2020	29 768 081	%	99.420	99.934	17.03. 17.09.	2.050	7.588 8.123	N
John Deere Capital Corp, Reno, USA												
Tranche 371 Emissionsdisagio von 0.113% 13.1.2017 Em.preis: 99.887%	USD	1'000.00	02.12.2011	13.01.2017	14 444 127		-	99.887	13.01. 13.01.	2.000	10.098 1.141	N
Tranche 373 Emissionsdisagio von 0.029% 15.3.2017 Em.preis: 99.971%	USD	1'000.00	27.02.2012	15.03.2017	18 058 850		-	99.971	15.03. 15.03.	1.400	7.056 0.29234	N
Emissionsdisagio von 0.183% 18.9.2017 Em.preis: 99.817%	USD	1'000.00	16.09.2010	18.09.2017	11 756 765		-	99.817	18.03. 18.09. 18.09.	2.800	13.953 13.443 1.757	N
Tranche 381 Emissionsdisagio von 0.207% 10.10.2017 Em.preis: 99.793%	USD	1'000.00	07.09.2012	10.10.2017	19 433 479		-	99.793	10.04. 10.10. 10.10.	1.200	6.048 5.845 2.016	N
	USD	1'000.00	11.03.2013	12.03.2018	20 897 920	%	98.920	99.769	12.03. 12.09.	1.300	6.544 6.237	N
Tranche 1	USD	1'000.00	03.04.2008	03.04.2018	3 923 223	%	100.050	99.694	03.04. 03.10.	5.350	26.831 26.050	N
Tranche 356	USD	1'000.00	08.09.2008	10.09.2018	4 555 041	%	102.590	99.647	08.03. 08.09.	5.750	29.169 27.247	N
Tranche 376 Series E	USD	1'000.00	17.04.2012	17.04.2019	18 407 050	%	100.170	99.730	17.04. 17.10.	2.250	11.268 11.025	N
	USD	1'000.00	09.09.2016	09.10.2019	33 878 598	%	98.450	99.798	09.04. 09.10.	1.250	7.350 6.122	N
	USD	1'000.00	12.10.2012	15.01.2020	19 791 631	%	99.000	99.661	15.01. 15.07.	1.700	8.593 8.185	N
Tranche 365	USD	1'000.00	12.07.2011	12.07.2021	13 350 524	%	104.710	99.893	12.01. 12.07.	3.900	19.657 18.801	N
Tranche 368	USD	1'000.00	11.10.2011	15.10.2021	14 040 866	%	102.890	99.549	15.04. 15.10.	3.150	15.775 15.358	N
Tranche 372	USD	1'000.00	27.02.2012	15.03.2022	18 059 063	%	100.570	99.825	15.03. 15.09.	2.750	13.861 13.204	N
Tranche 378	USD	1'000.00	29.06.2012	27.01.2023	18 924 943	%	99.210	99.726	27.01. 27.07.	2.800	13.973 13.484	N
	USD	1'000.00	04.03.2016	06.03.2023	31 789 006	%	100.060	99.880	06.03. 06.09.	2.800	14.157 13.352	N
John Deere Financial Ltd, Crestmead, Australien												
	AUD	10'000.00	18.12.2014	18.12.2019	26 395 682	%	101.720	99.478	18.06. 18.12.	3.500	129.19 132.72	N
Johnson & Johnson, New Brunswick, USA												
	USD	1'000.00	16.08.2007	15.08.2017	3 334 801		-	100.000	15.02. 15.08.	5.550	27.983 26.996	N
	USD	1'000.00	23.06.2008	15.07.2018	4 341 967	%	101.800	99.794	15.01. 15.07.	5.150	26.032 24.797	N
	EUR	50'000.00	06.11.2007	06.11.2019	3 528 208	%	108.960	99.266	06.11.	4.750	2'753.21	N
	USD	1'000.00	17.08.2010	01.09.2020	11 642 344	%	102.040	98.289	01.03. 01.09.	2.950	14.881 14.198	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	GBP	50'000.00	06.11.2007	06.11.2024	3 529 752	%	125.820	99.227	06.11.	5.500	3'610.55	N
JPMorgan Chase & Co., New York, USA												
	GBP	1'000.00	25.01.2011	25.01.2017	12 357 477		-	99.696	25.01.	4.250	27.000	N
Emissionsdisagio von 0.304% 25.1.2017 Em.preis: 99.696%									25.01.		3.831	
	RUB	2'000'000.00	28.06.2007	28.06.2017	3 220 825		-	98.264	28.06.	7.000	2'263.38	N
Emissionsdisagio von 1.736% 28.6.2017 Em.preis: 98.264%									28.06.		561.31	
Tranche 1	AUD	10'000.00	07.11.2012	07.11.2017	19 921 085		-	99.824	07.05.	4.650	169.88	N
									07.11.		178.85	
Emissionsdisagio von 0.176% 7.11.2017 Em.preis: 99.824%									07.11.		13.428	
	AUD	10'000.00	17.05.2013	17.05.2018	21 360 727	%	100.470	99.821	17.05.	4.100	147.81	N
									17.11.		154.64	
	AUD	10'000.00	09.12.2014	09.12.2019	26 275 648	%	102.130	98.944	09.06.	3.750	136.59	N
									09.12.		140.47	
	CHF	5'000.00	06.05.2014	06.11.2020	24 301 708	%	103.850	100.693	06.11.	1.125	56.250	N
	NOK	10'000.00	01.06.2017	01.06.2021	36 954 825	%	99.250	99.500		1.375	0.000	N
	CHF	5'000.00	04.03.2015	04.12.2023	27 202 466	%	102.300	100.117	04.12.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	11.05.2016	11.11.2026	31 941 599	%	101.000	100.450	11.11.	0.450	22.500	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
KazAgro National management holding JSC, Kasachstan												
	EUR	1'000.00	22.05.2014	22.05.2019	24 483 528	%	102.150	100.000	22.05.	3.255	35.614	N
Kellogg Company, Battle Creek, USA												
	EUR	1'000.00	23.05.2014	24.05.2021	24 504 180	%	104.770	99.511	24.05.	1.750	19.116	N
Kering, Paris, Frankreich												
	EUR	1'000.00	23.04.2012	23.04.2019	18 416 704	%	104.120	99.247	23.04.	3.125	33.792	N
Kingdom of Denmark, Copenhagen, Dänemark												
	DKK	0.010	30.01.2006	15.11.2017	2 423 480		-	104.450	15.11.	4.000	0.00006	N
	DKK	0.010	06.04.1994	10.11.2024	224 255	%	147.330	96.250	10.11.	7.000	0.0001	N
Kingdom of Saudi Arabia, Riyadh, Saudi-Arabien												
	USD	1'000.00	26.10.2016	26.10.2021	34 357 206	%	97.480	99.007	26.04. 26.10.	2.375	11.811 11.833	N
Kiwibank Ltd., Neuseeland												
	CHF	5'000.00	04.04.2014	04.04.2019	23 903 431	%	101.650	100.793	04.04.	0.875	43.750	N
	CHF	5'000.00	23.04.2013	23.12.2020	20 988 651	%	103.850	100.972	23.12.	1.000	50.000	N
Klepiérre, Paris, Frankreich												
	EUR	1'000.00	20.10.2010	22.01.2018	11 887 498	%	99.400	99.694	22.01.	4.625	49.773	N
	EUR	1'000.00	28.02.2013	26.02.2021	20 784 594	%	110.090	99.945	26.02.	3.250	34.779	N
KLM Royal Dutch Airlines, Amstelveen, Niederlande												
nachrangige Anleihe	CHF	5'000.00	12.02.1985		536 205	%	38.000	100.000	12.02.	2.125	37.500	N
nachrangige Anleihe	CHF	5'000.00	15.05.1986		536 209	%	105.850	100.000	15.05.	5.750	287.50	N
Koenigreich der Niederlande, Den Haag, Niederlande												
	EUR	1.00	24.06.2011	15.01.2017	13 219 599		-	99.250	15.01. 15.01.	2.500	0.02687 0.00804	N
Emissionsdisagio von 0.75% 15.1.2017 Em.preis: 99.25%												
	USD	1'000.00	24.02.2012	24.02.2017	18 020 832		-	99.070	24.02. 24.02.	1.000	5.033 9.362	N
Emissionsdisagio von 0.93% 24.2.2017 Em.preis: 99.07%												
	EUR	1.00	17.01.2014	15.04.2017	23 320 326		-	99.770	15.04. 15.04.	0.500	0.00534 0.00245	N
Emissionsdisagio von 0.23% 15.4.2017 Em.preis: 99.77%												
	EUR	1.00	06.07.2012	15.01.2018	18 960 518	%	100.080	99.710	15.01.	1.250	0.01343	N
	EUR	1.00	25.02.2008	15.07.2018	3 803 017	%	102.470	98.450	15.07.	4.000	0.04418	N
	EUR	1.00	28.06.2013	15.01.2019	21 719 531	%	102.030	99.250	15.01.	1.250	0.01343	N
	EUR	1.00	29.09.2014	15.01.2020	25 522 083	%	101.790	99.350	15.01.	0.250	0.00268	N
	EUR	1.00	05.02.2010	15.07.2020	10 981 056	%	110.320	99.800	15.07.	3.500	0.03866	N
	EUR	1.00	04.03.2011	15.07.2021	12 591 155	%	113.020	97.920	15.07.	3.250	0.0359	N
	EUR	1.00	10.02.2012	15.07.2022	14 933 116	%	111.280	99.000	15.07.	2.250	0.02485	N
	EUR	1.00	17.02.2006	15.01.2023	2 443 208	%	119.650	100.520	15.01.	3.750	0.04031	N
	EUR	1.00	22.03.2013	15.07.2023	20 984 949	%	109.960	99.250	15.07.	1.750	0.01933	N
	EUR	1.00	26.03.2015	15.07.2025	27 630 112	%	100.030	98.620	15.07.	0.250	0.00276	N
	EUR	1.00	19.03.1998	15.01.2028	950 633	%	148.670	100.270	15.01.	5.500	0.05912	N
Koenigreich Norwegen, Oslo, Norwegen												
	NOK	1'000.00	19.05.2006	19.05.2017	2 565 054		-	99.000	19.05. 19.05.	4.250	4.948 1.164	N
Emissionsdisagio von 1% 19.5.2017 Em.preis: 99%												
Koenigreich Schweden, Stockholm, Schweden												
	SEK	5'000.00	13.09.2006	12.08.2017	2 699 855		-	100.000	12.08.	3.750	22.425	N
	SEK	5'000.00	21.11.2007	12.03.2019	3 562 913	%	106.050	100.468	12.03.	4.250	23.908	N
	SEK	5'000.00	28.01.2004	01.12.2020	1 776 617	%	115.830	100.610	01.12.	5.000	29.389	N
Koenigreich Spanien, Spanien												
	EUR	1'000.00	18.10.2006	31.01.2017	2 741 385		-	99.546	31.01. 31.01.	3.800	40.626 4.840	N
Emissionsdisagio von 0.454% 31.1.2017 Em.preis: 99.546%												
	EUR	1'000.00	26.11.2013	30.04.2017	22 899 812		-	99.988	30.04. 30.04.	2.100	22.788 0.13021	N
Emissionsdisagio von 0.012% 30.4.2017 Em.preis: 99.988%												
	EUR	1'000.00	11.03.2002	30.07.2017	1 388 465		-	99.458	30.07. 30.07.	5.500	62.568 6.165	N
Emissionsdisagio von 0.542% 30.7.2017 Em.preis: 99.458%												

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	EUR	1'000.00	23.09.2014	31.10.2017	25 478 176		-	99.799	31.10. 31.10.	0.500	5.806 2.334	N
Emissionsdisagio von 0.201% 31.10.2017 Em.preis: 99.799%												
	EUR	1'000.00	13.11.2012	31.01.2018	19 973 047	%	100.340	99.198	31.01.	4.500	48.110	N
	EUR	1'000.00	19.02.2008	30.07.2018	3 793 634	%	102.630	99.214	30.07.	4.100	46.641	N
	EUR	1'000.00	09.07.2013	31.10.2018	21 776 795	%	103.530	99.816	31.10.	3.750	43.545	N
	EUR	1'000.00	10.02.2009	30.07.2019	2 144 899	%	107.750	99.602	30.07.	4.600	52.329	N
	EUR	1'000.00	02.06.2009	31.10.2019	10 235 389	%	108.460	99.078	31.10.	4.300	49.931	N
	EUR	1'000.00	20.01.2010	30.04.2020	10 917 965	%	109.660	99.224	30.04.	4.000	43.406	N
	EUR	1'000.00	13.07.2010	31.10.2020	11 515 044	%	113.900	99.833	31.10.	4.850	56.318	N
	EUR	1'000.00	24.01.2011	30.04.2021	12 351 892	%	118.060	99.233	30.04.	5.500	59.683	N
	EUR	1'000.00	08.03.2016	30.07.2021	31 777 442	%	102.280	100.292	30.07.	0.750	8.532	N
	EUR	1'000.00	22.11.2011	31.01.2022	14 323 050	%	123.020	92.007	31.01.	5.850	62.543	N
	EUR	1'000.00	29.01.2013	31.01.2023	20 534 695	%	125.050	99.991	31.01.	5.400	57.732	N
	EUR	1'000.00	16.09.2008	31.01.2024	4 566 863	%	124.720	98.753	31.01.	4.800	51.317	N
	EUR	1'000.00	29.01.2014	30.04.2024	23 500 103	%	119.200	99.638	30.04.	3.800	41.235	N
	EUR	1'000.00	20.06.2014	31.10.2024	24 698 640	%	112.810	100.082	31.10.	2.750	31.933	N
	EUR	1'000.00	27.01.2015	30.04.2025	26 807 636	%	104.640	99.478	30.04.	1.600	17.362	N
	EUR	1'000.00	24.02.2010	30.07.2025	11 048 014	%	126.650	99.831	30.07.	4.650	52.898	N
	EUR	1'000.00	09.06.2015	31.10.2025	28 454 009	%	107.740	99.481	31.10.	2.150	24.965	N
	EUR	1'000.00	15.03.2011	30.07.2026	12 663 913	%	137.490	98.936	30.07.	5.900	67.118	N
	EUR	1'000.00	16.07.2013	31.10.2028	21 867 939	%	134.360	99.570	31.10.	5.150	59.801	N
	EUR	0.010	15.01.1998	31.01.2029	839 909	%	143.310	94.846	31.01.	6.000	0.00064	N
	EUR	1'000.00	23.01.2001	30.07.2032	1 182 580	%	147.000	93.718	30.07.	5.750	65.412	N
	EUR	1'000.00	31.01.2005	31.01.2037	2 044 921	%	128.380	98.850	31.01.	4.200	44.903	N
	EUR	1'000.00	20.06.2007	30.07.2040	3 203 526	%	140.700	99.655	30.07.	4.900	55.742	N
	EUR	1'000.00	28.09.2009	30.07.2041	10 596 106	%	137.590	99.753	30.07.	4.700	53.467	N
Kommunalbanken A/S, Oslo, Norwegen												
	AUD	2'000.00	12.04.2012	12.04.2017	18 364 458		-	99.145	12.04. 12.04.	4.750	35.656 12.871	N
Emissionsdisagio von 0.855% 12.4.2017 Em.preis: 99.145%												
	NZD	1'000.00	02.05.2012	02.05.2017	18 436 139		-	99.333	02.05. 02.05.	4.250	14.509 4.590	N
Emissionsdisagio von 0.6667% 2.5.2017 Em.preis: 99.3333%												
	CHF	5'000.00	09.02.2009	09.05.2017	4 946 309		-	100.984	09.05.	2.875	143.75	N
	NOK	10'000.00	16.05.2012	16.05.2017	18 549 888		-	101.235	16.05.	2.875	33.475	N
	NOK	10'000.00	12.09.2012	12.12.2017	19 440 558		-	100.656	12.12.	2.250	26.710	N
	NZD	1'000.00	03.03.2011	05.03.2018	14 695 037	%	100.310	100.000	05.03. 05.09.	5.320	18.846 18.448	N
	NOK	10'000.00	03.05.2013	03.05.2018	21 275 171	%	100.290	100.688	03.05.	2.000	22.987	N
	CAD	1'000.00	16.05.2013	16.05.2018	21 399 845	%	100.200	99.876	16.05. 16.11.	1.850	6.656 7.273	N
	AUD	2'000.00	30.05.2013	30.05.2018	21 495 861	%	100.610	100.000	31.05. 30.11.	3.500	25.141 26.163	N
	AUD	2'000.00	23.01.2014	23.01.2019	23 428 583	%	101.860	99.563	23.01. 23.07.	4.000	30.529 29.774	N
	AUD	1'000.00	18.07.2012	18.07.2022	19 039 707	%	107.420	98.713	18.01. 18.07.	4.500	17.047 16.996	N
	NZD	1'000.00	07.06.2016	07.06.2023	32 717 830	%	100.440	99.666	07.06. 07.12.	3.375	11.676 11.497	N
Kommunalkredit Austria AG, Wien, Österreich												
	CHF	5'000.00	15.03.2005	15.03.2017	2 066 958		-	101.010	15.03.	2.375	118.75	N
	CHF	5'000.00	26.08.2005	26.08.2020	2 228 005	%	105.850	100.120	26.08.	2.375	118.75	N
	CHF	5'000.00	14.02.2006	14.02.2022	2 401 545	%	109.600	101.905	14.02.	2.500	125.00	N
	CHF	5'000.00	22.06.2006	22.06.2026	2 566 283	%	122.550	101.430	22.06.	3.375	168.75	N
Kommunekredit, Copenhagen, Dänemark												
	CHF	5'000.00	08.05.2008	08.05.2018	3 919 345	%	101.430	100.086	08.05.	3.250	162.04	N
	CAD	1'000.00	07.08.2015	07.08.2018	29 045 355	%	99.400	99.749	07.02. 07.08.	0.875	3.344 3.325	N
	CHF	5'000.00	16.02.2010	16.08.2019	10 937 017	%	104.800	101.095	16.08.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	09.03.2011	09.10.2020	12 447 090	%	107.400	100.640	09.10.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	09.07.2015	09.07.2027	28 559 737	%	105.900	101.335	09.07.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	13.10.2006	13.10.2031	2 698 552	%	134.200	100.735	13.10.	2.875	143.75	N
Kommuninvest i Sverige AB, Orebro, Schweden												
	USD	1'000.00	13.02.2012	13.02.2017	14 953 517		-	99.597	13.02. 13.02.	1.625	16.332 4.050	N
Emissionsdisagio von 0.403% 13.2.2017 Em.preis: 99.597%												
	CHF	5'000.00	28.02.2012	28.02.2022	14 893 764	%	106.650	100.937	28.02.	1.250	62.500	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Korea Development Bank (The), Seoul, Korea (Republik)												
Emissionsdisagio von 0.451% 4.5.2017 Em.preis: 99.549%	USD	1'000.00	04.11.2011	04.05.2017	14 220 138		-	99.549	04.05. 04.05.	3.875	19.197 4.468	N
	NZD	2'000.00	03.04.2014	03.04.2018	24 039 544	%	100.520	99.673	03.04.	5.250	73.711	N
	CHF	5'000.00	02.10.2013	02.07.2018	22 352 329	%	100.880	100.469	02.07.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	29.10.2012	29.10.2018	19 692 403	%	101.150	100.267	29.10.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	21.12.2012	21.12.2018	20 122 519	%	101.450	100.354	21.12.	1.000	50.000	N
	NZD	2'000.00	13.11.2014	13.11.2020	26 019 734	%	104.010	99.849	13.11.	5.125	70.421	N
Korea Electric Power Corporation, Naju, Korea (Republik)												
	CHF	5'000.00	23.10.2013	23.04.2019	22 241 823	%	101.920	100.654	23.04.	1.500	75.000	N
Korea Expressway Corporation, Songnam, Korea (Republik)												
	CHF	5'000.00	15.12.2014	15.03.2018	26 117 803	%	100.100	100.000	15.03. 15.06. 15.09. 15.12.	VAR.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Korea Gas Corporation, Daegu, Korea (Republik)	CHF	5'000.00	07.06.2017	07.06.2024	36 550 150	%	100.750	100.243		0.250	0.000	N
	CHF	5'000.00	11.10.2011	11.10.2019	13 877 587	%	104.900	100.876	11.10.	2.875	143.75	N
Korea Hydro & Nuclear Power Co Ltd, Seoul, Korea (Republik)	CHF	5'000.00	12.02.2013	12.02.2020	20 467 802	%	102.600	100.650	12.02.	1.125	56.250	N
	USD	1'000.00	13.07.2011	13.07.2021	13 335 649	%	105.860	97.591	13.01. 13.07.	4.750	23.983 22.982	N
Korea National Oil Corporation, Ulsan, Korea (Republik)	USD	1'000.00	19.09.2012	19.09.2022	19 505 655	%	99.610	98.401	19.03. 19.09.	3.000	14.949 14.441	N
	CHF	5'000.00	08.03.2012	08.03.2017	14 971 077		-	100.580	08.03.	1.875	93.750	N
	CHF	5'000.00	29.07.2013	29.11.2018	21 798 637	%	101.630	100.246	29.11.	1.625	81.250	N
	AUD	10'000.00	08.10.2014	08.10.2019	25 571 971	%	101.820	99.555	08.04. 08.10.	4.250	160.19 162.03	N
Korea Railroad Corporation, Daejeon City, Korea (Republik)												
	CHF	5'000.00	16.11.2012	16.11.2018	19 861 944	%	101.290	100.578	16.11.	1.000	50.000	N
Korea South East Power Co., Ltd., Seoul, Korea (Republik)	CHF	5'000.00	02.12.2013	02.12.2019	22 517 329	%	102.800	100.123	02.12.	1.500	75.000	N
Emissionsdisagio von 0.753% 29.1.2017 Em.preis: 99.247%	USD	1'000.00	29.07.2011	29.01.2017	13 436 214		-	99.247	29.01. 29.01.	3.625	18.073 7.508	N
Korea Western Power Co., Ltd., Taean, Korea (Republik)												
	CHF	5'000.00	26.09.2013	26.03.2019	21 507 631	%	102.190	100.354	26.03.	1.625	81.250	N
KPN NV (Koninklijke), Den Haag, Niederlande												
Emissionsdisagio von 0.212% 17.1.2017 Em.preis: 99.788%	EUR	1'000.00	13.11.2006	17.01.2017	2 784 461		-	99.788	17.01. 17.01.	4.750	51.071 2.273	N
	EUR	1'000.00	04.02.2009	04.02.2019	1 501 629	%	108.020	98.889	04.02.	7.500	80.179	N
	GBP	1'000.00	29.05.2007	29.05.2019	3 130 730	%	106.520	97.977	29.05.	6.000	75.221	N
Krankenanstalten Immobiliengesellschaft m.b.H (KIG), Graz, Österreich	GBP	1'000.00	17.09.2009	17.09.2029	10 541 360	%	126.480	98.885	17.09.	5.750	74.723	N
Emissionsdisagio von 0.938% 25.1.2017 Em.preis: 99.062%	EUR	50'000.00	25.01.2010	25.01.2017	10 934 148		-	99.062	25.01. 25.01.	3.625	1'950.59 503.35	N
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau KFW, Frankfurt am Main, Deutschland												
	TRY	1'000.00	16.01.2013	16.01.2017	20 434 111		-	100.536	16.01.	5.000	13.306	N
Emissionsdisagio von 0.648% 17.1.2017 Em.preis: 99.352%	USD	1'000.00	17.01.2007	17.01.2017	2 870 938		-	99.352	17.01. 17.01.	4.875	24.441 6.497	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Emissionsdisagio von 1.73% 26.1.2017 Em.preis: 98.27%	TRY	1'000.00	26.01.2007	26.01.2017	2 877 789		-	98.270	26.01. 26.01.	14.500	37.655 4.480	N
Emissionsdisagio von 0.531% 21.2.2017 Em.preis: 99.469%	EUR	1'000.00	21.02.2012	21.02.2017	18 005 168		-	99.469	21.02. 21.02.	1.375	14.666 5.648	N
Emissionsdisagio von 0.037% 28.3.2017 Em.preis: 99.963%	AUD	1'000.00	28.03.2007	28.03.2017	3 007 101		-	99.963	28.03. 28.03.	6.000	22.347 0.2779	N
Emissionsdisagio von 0.35% 15.5.2017 Em.preis: 99.65%	TRY	1'000.00	04.02.2014	15.05.2017	23 499 666		-	99.650	15.05. 15.05.	9.250	25.933 0.98128	N
	NOK	500'000.00	28.08.2008	19.05.2017	4 515 672		-	100.000	19.05.	5.250	3'056.28	N
Emissionsdisagio von 0.333% 23.5.2017 Em.preis: 99.667%	ISK	100'000.00	23.05.2007	23.05.2017	3 102 743		-	99.667	23.05. 23.05.	7.750	75.260 3.233	N
Emissionsdisagio von 0.146% 4.7.2017 Em.preis: 99.854%	EUR	1'000.00	30.01.2007	04.07.2017	2 895 345		-	99.854	04.07. 04.07.	4.125	45.187 1.599	N
Emissionsdisagio von 0.776% 10.8.2017 Em.preis: 99.224%	AUD	1'000.00	10.08.2012	10.08.2017	19 185 969		-	99.224	10.02. 10.08. 10.08.	3.750	14.573 14.141 5.901	N
	SEK	1'000'000.00	12.05.2008	12.08.2017	4 215 269		-	100.351	12.08.	4.750	5'681.19	N
	NZD	1'000.00	16.08.2012	16.08.2017	19 258 278		-	101.468	16.08.	3.750	26.565	N
	NOK	10'000.00	18.08.2010	18.08.2017	11 629 431		-	101.143	18.08.	3.375	40.891	N
	GBP	1'000.00	16.11.2001	25.08.2017	1 323 329		-	100.000	25.08.	5.625	69.426	N
	CHF	5'000.00	30.08.2007	30.08.2017	3 289 762		-	101.070	30.08.	3.375	168.75	N
Emissionsdisagio von 0.186% 21.9.2017 Em.preis: 99.814%	EUR	1'000.00	21.09.2010	21.09.2017	11 761 528		-	99.814	21.09. 21.09.	2.250	26.102 2.157	N
	RUB	50'000.00	25.09.2012	25.09.2017	19 506 383		-	101.625	25.09.	6.750	56.787	N
	SEK	1'000'000.00	29.10.2010	15.01.2018	11 967 395	%	100.110	100.513	15.01.	3.500	3'951.88	N
	EUR	0.010	22.01.1998	22.01.2018	839 668	%	100.340	99.090	22.01.	5.500	0.00059	N
	NOK	10'000.00	22.01.2013	22.01.2018	20 455 979	%	100.000	101.392	22.01.	2.375	28.435	N
	GBP	1'000.00	01.02.2008	01.02.2018	3 728 618	%	100.350	99.659	01.02.	4.875	61.346	N
	USD	1'000.00	04.03.2008	15.03.2018	3 831 116	%	100.530	99.213	15.03. 15.09.	4.375	22.051 21.006	N
	ZAR	5'000.00	09.10.2013	09.04.2018	22 520 095	%	99.900	100.975	09.04.	7.000	25.346	N
	CAD	1'000.00	13.06.2013	13.06.2018	21 589 740	%	100.210	99.609	13.06. 13.12.	1.875	6.845 7.233	N
	NZD	1'000.00	14.06.2013	14.06.2018	21 596 225	%	100.530	101.470	14.06.	3.750	26.505	N
	EUR	1'000.00	16.01.2008	04.07.2018	3 678 942	%	102.470	99.519	04.07.	4.375	47.925	N
	USD	1'000.00	10.06.2008	16.07.2018	4 293 400	%	101.440	99.697	16.01. 16.07.	4.500	22.747 21.667	N
	AUD	1'000.00	18.01.2013	18.07.2018	20 436 003	%	100.930	99.349	18.01. 18.07.	3.750	14.322 14.047	N
	CHF	5'000.00	11.03.2009	11.10.2018	2 061 619	%	102.820	100.940	11.10.	2.750	137.50	N
	AUD	1'000.00	16.01.2014	16.01.2019	23 306 901	%	101.810	99.821	16.01. 16.07.	4.000	15.239 14.932	N
	EUR	1'000.00	20.01.2009	21.01.2019	4 972 538	%	104.700	99.471	21.01.	3.875	41.702	N
	ZAR	5'000.00	21.01.2014	21.01.2019	23 456 560	%	99.520	100.469	21.01.	7.000	25.952	N
	TRY	1'000.00	06.03.2014	06.03.2019	23 845 689	%	97.880	99.874	06.03.	10.000	27.258	N
	NOK	500'000.00	07.04.2009	22.05.2019	10 115 919	%	105.330	100.000	22.05.	5.000	2'916.40	N
	EUR	1'000.00	16.08.2011	16.08.2019	13 590 835	%	105.180	99.156	16.08.	2.625	29.963	N
	CHF	5'000.00	01.04.2010	01.10.2019	11 105 666	%	104.850	100.336	01.10.	2.000	100.00	N
	CAD	1'000.00	29.10.2014	29.10.2019	25 883 940	%	99.830	99.458	29.04. 29.10.	1.750	6.350 6.815	N
	NZD	1'000.00	06.11.2014	06.11.2019	25 959 630	%	103.010	101.291	06.11.	4.250	29.328	N
	GBP	1'000.00	15.01.2015	23.12.2019	26 643 831	%	101.030	99.521	23.12.	1.125	14.879	N
	EUR	1'000.00	19.01.2010	20.01.2020	10 912 239	%	108.500	99.934	20.01.	3.625	39.020	N
	CAD	1'000.00	28.01.2015	28.01.2020	26 807 373	%	98.850	99.462	28.01. 28.07.	1.375	5.278 5.316	N
	SEK	1'000'000.00	24.02.2010	24.02.2020	11 081 886	%	108.490	100.000	24.02.	3.845	4'296.44	N
	AUD	1'000.00	16.01.2015	16.04.2020	26 606 552	%	100.960	99.876	18.04. 16.10.	2.750	10.270 10.571	N
	NZD	1'000.00	29.05.2015	29.05.2020	28 320 148	%	102.810	99.369	29.05. 29.11.	3.750	12.844 12.818	N
	CHF	5'000.00	12.02.2010	12.08.2020	10 713 471	%	107.500	100.281	12.08.	2.250	112.50	N
	NZD	1'000.00	20.08.2014	20.08.2020	25 211 719	%	104.600	100.841	20.08.	4.500	31.686	N
	NOK	10'000.00	04.05.2017	04.11.2020	33 885 019	%	100.090	100.000	04.11.	1.000	6.168	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	SEK	1'000'000.00	15.12.2006	01.12.2020	2 829 837	%	113.800	113.913	01.12.	5.000	5'877.80	N
	USD	1'000.00	25.05.2016	15.06.2021	32 649 797	%	97.520	99.767	15.06. 15.12.	1.500	7.311 7.438	N
	EUR	1'000.00	17.01.2006	04.07.2021	2 403 670	%	113.200	99.475	04.07.	3.500	38.340	N
	AUD	1'000.00	09.02.2012	09.02.2022	14 917 602	%	111.150	99.924	09.02. 09.08.	5.500	21.164 20.729	N
	CHF	5'000.00	25.08.2005	25.08.2025	2 226 800	%	119.900	100.990	25.08.	2.500	125.00	N
	EUR	1'000.00	09.03.2016	09.03.2026	31 809 018		n.v.	98.900	09.03.	0.375	4.025	N
	USD	1'000.00	19.04.2006	18.04.2036	2 527 852	%	58.210	19.778		0.000	0.000	Y
	CHF	5'000.00	16.02.2007	16.02.2037	2 900 880	%	142.150	100.345	16.02.	2.750	137.50	N
	USD	1'000.00	29.06.2007	29.06.2037	3 215 872	%	55.990	18.097		0.000	0.000	Y
K+S Aktiengesellschaft, Kassel, Deutschland												
	EUR	1'000.00	06.12.2013	06.12.2018	23 044 879	%	102.350	99.777	06.12.	3.125	36.464	N
Tranche 2	EUR	1'000.00	06.12.2013	06.12.2021	23 044 877	%	111.000	99.539	06.12.	4.125	48.132	N
	EUR	100'000.00	20.06.2012	20.06.2022	18 823 957	%	106.870	99.422	20.06.	3.000	3'257.55	N
Kuwait Projects Co SPC Limited, Dubai, Vereinigte Arabische Emirate												
	USD	1'000.00	05.02.2014	05.02.2019	23 593 658	%	101.980	100.000	05.02. 05.08.	4.800	23.824 23.337	N
Kuznetski Capital SA, Luxemburg												
	USD	1'000.00	10.05.2007	10.05.2017	3 080 542		-	100.000	10.05.	VAR.	30.353	N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
La Electricidad de Caracas SAICA EDC, Caracas, Venezuela												
	USD	1'000.00	10.04.2008	10.04.2018	3 933 549	%	37.000	105.000	10.04. 10.10.	8.500	42.842 41.404	N
La Poste, Paris, Frankreich												
	EUR	1'000.00	27.02.2008	27.02.2018	3 798 487	%	99.990	99.945	27.02.	4.500	48.155	N
	EUR	1'000.00	08.07.2004	08.07.2019	1 891 384	%	106.850	98.868	10.07.	4.750	52.586	N
	EUR	1'000.00	08.11.2006	08.11.2021	2 764 689	%	114.940	99.239	08.11.	4.250	49.240	N
	EUR	1'000.00	26.06.2003	26.06.2023	1 623 104	%	120.070	98.826	26.06.	4.375	47.558	N
Ladbrokes Group Finance PLC, Harrow, Grossbritannien												
	GBP	1'000.00	05.03.2010	05.03.2017	11 082 624		-	100.000	05.03.	7.625	46.862	N
Lafarge SA, Paris, Frankreich												
	EUR	50'000.00	26.06.2007	26.06.2017	3 205 212		-	99.584	26.06. 26.06.	5.375	2'921.44 226.10	N
Emissionsdisagio von 0.416% 26.6.2017 Em.preis: 99.584%												
	GBP	1'000.00	29.11.2002	29.11.2017	1 518 608		-	99.546	29.11. 29.11.	6.625	87.431 5.991	N
Emissionsdisagio von 0.454% 29.11.2017 Em.preis: 99.546%												
	EUR	1'000.00	29.11.2010	29.11.2018	12 052 118	%	104.710	99.733	29.11.	VAR.	62.688	N
	EUR	1'000.00	09.07.2012	09.07.2019	18 971 007	%	108.680	99.302	09.07.	5.875	64.686	N
	EUR	1'000.00	23.03.2005	23.03.2020	2 095 109	%	109.220	99.474	23.03.	4.750	50.851	N
Land Baden-Wuerttemberg, Stuttgart, Deutschland												
	EUR	1'000.00	23.01.2008	04.01.2018	3 706 739	%	99.980	99.353	04.01.	4.250	45.701	N
	EUR	1'000.00	22.01.2009	22.01.2019	4 980 482	%	104.690	99.797	22.01.	4.000	43.047	N
Land Berlin, Berlin, Deutschland												
	CHF	5'000.00	03.05.2007	03.05.2017	3 015 007		-	100.805	03.05.	2.750	137.50	N
	EUR	1'000.00	22.06.2005	22.06.2017	2 193 602		-	99.048	22.06. 22.06.	3.500	37.966 10.326	N
Emissionsdisagio von 0.952% 22.6.2017 Em.preis: 99.048%												
Land Hessen, Wiesbaden, Deutschland												
	EUR	1'000.00	25.01.2005	25.01.2017	2 052 853		-	98.961	25.01. 25.01.	3.625	39.011 11.151	N
Emissionsdisagio von 1.039% 25.1.2017 Em.preis: 98.961%												
	CHF	5'000.00	22.05.2008	22.05.2017	3 948 067		-	101.000	22.05.	3.250	162.50	N
	CHF	5'000.00	27.04.2010	29.04.2030	11 138 614	%	125.350	100.592	05.02.	2.500	125.00	N
	EUR	1'000.00	04.08.2016	04.08.2036	33 456 201	%	90.700	99.815	04.08.	0.750	8.575	N
Land Niederoesterreich, St.Poelten, Österreich												
	CHF	5'000.00	15.03.2010	15.08.2017	11 033 587		-	100.834	15.08.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	15.08.2017	29.06.2018	37 094 359	%	100.330	100.615		0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	15.08.2017	28.06.2019	37 094 360	%	100.850	100.894		0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	07.08.2015	07.08.2020	28 897 752	%	101.350	100.149	07.08.	0.200	10.000	N
	CHF	5'000.00	27.10.2014	27.04.2021	25 688 650	%	102.000	100.775	27.04.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	27.10.2014	27.10.2022	25 688 653	%	102.950	100.574	27.10.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	22.09.2015	22.09.2023	29 623 195	%	102.500	100.000	22.09.	0.350	17.500	N
	CHF	5'000.00	24.10.2016	23.10.2026	33 635 281	%	99.250	100.000	23.10.	0.040	1.994	N
Land Nordrhein-Westfalen, Duesseldorf, Deutschland												
	EUR	1'000.00	03.03.2005	03.03.2017	2 084 428		-	99.037	03.03. 03.03.	3.750	40.029 10.279	N
Emissionsdisagio von 0.963% 3.3.2017 Em.preis: 99.037%												
	NOK	10'000.00	20.04.2012	20.04.2017	18 357 407		-	101.398	20.04.	3.250	37.620	N
	CHF	5'000.00	01.03.2006	01.03.2019	2 415 141	%	103.430	100.440	01.03.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	29.07.2014	29.07.2024	24 816 666	%	106.550	100.941	29.07.	0.875	43.750	N
	MXN	100'000.00	08.06.2007	08.06.2027	3 116 056	%	93.830	98.625	08.06.	7.500	398.16	N
Land Rheinland-Pfalz, Mainz, Deutschland												
	EUR	1'000.00	03.03.2010	03.03.2017	11 071 557		-	99.308	03.03. 03.03.	2.875	30.689 7.386	N
Emissionsdisagio von 0.692% 3.3.2017 Em.preis: 99.308%												
	EUR	1'000.00	26.02.2008	02.03.2018	3 828 880	%	100.760	98.658	02.03.	4.250	45.224	N
Landesbank Hessen-Thueringen Girozentrale, Frankfurt, Deutschland												
	EUR	1'000.00	16.07.2014	16.07.2024	24 943 203	%	103.800	100.000	16.07.	VAR.	14.360	N
Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg-Foerderbank, Karlsruhe, Deutschland												
	NOK	10'000.00	22.05.2012	22.05.2017	18 576 896		-	101.251	22.05.	3.000	34.996	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Emissionsdisagio von 0.11%	EUR	1'000.00	12.12.2012	12.12.2017	20 192 617		-	99.890	12.12. 12.12.	0.750	8.731 1.280	N
	AUD	1'000.00	23.01.2014	23.01.2018	23 444 437	%	99.950	100.000	23.01. 23.07.	3.750	14.310 13.956	N
Landsbankinn hf., Reykjavik, Island	USD	1'000.00	21.07.2016	21.07.2021	33 307 787	%	96.810	99.664	21.07.	1.375	13.027	N
	EUR	1'000.00	15.09.2016	15.03.2021	33 913 708	%	103.070	99.566	15.03.	1.625	8.635	N
Landshypotek Bank AB, Stockholm, Schweden												
	CHF	5'000.00	24.10.2011	24.10.2018	13 928 538	%	101.800	100.948	24.10.	1.500	75.000	N
Landwirtschaftliche Rentenbank, Frankfurt am Main, Deutschland												
	CHF	5'000.00	16.04.2010	16.01.2017	11 146 131		-	100.710	16.01.	1.750	87.500	N
Emissionsdisagio von 0.015% 1.2.2017 Em.preis: 99.985%	USD	1'000.00	01.02.2007	01.02.2017	2 896 430		-	99.985	01.02. 01.02.	5.125	25.428 0.14884	N
	SEK	10'000.00	17.02.2012	17.02.2017	14 964 781		-	101.024	17.02.	2.500	28.203	N
Emissionsdisagio von 0.388% 12.4.2017 Em.preis: 99.612%	AUD	1'000.00	12.04.2010	12.04.2017	11 191 238		-	99.612	12.04. 12.04.	6.500	24.396 2.920	N
Emissionsdisagio von 0.757% 10.5.2017 Em.preis: 99.243%	NZD	2'000.00	10.05.2007	10.05.2017	3 080 553		-	99.243	10.05. 10.05.	7.000	98.036 10.601	N
	CHF	5'000.00	29.08.2005	29.08.2017	2 231 210		-	100.140	29.08.	2.125	106.25	N
Emissionsdisagio von 0.224% 12.9.2017 Em.preis: 99.776%	USD	1'000.00	12.09.2012	12.09.2017	19 443 050		-	99.776	12.03. 12.09. 12.09.	0.875	4.404 4.198 2.149	N
Emissionsdisagio von 0.563% 13.9.2017 Em.preis: 99.437%	USD	1'000.00	13.09.2010	13.09.2017	11 722 599		-	99.437	13.03. 13.09. 13.09.	2.375	11.956 11.438 5.423	N
19.9.2017 Em.preis: 99.95908%	NZD	1'000.00	19.03.2013	19.09.2017	20 886 965		-	99.959	19.03. 19.09. 19.09.	3.875	13.499 13.758 0.28821	N
Emissionsdisagio von 0.35% 27.11.2017 Em.preis: 99.65%	EUR	1'000.00	27.11.2007	27.11.2017	3 572 554		-	99.650	27.11. 27.11.	4.375	51.148 4.091	N
	TRY	1'000.00	27.02.2013	27.02.2018	20 776 526	%	98.800	101.229	27.02.	5.625	15.775	N
	EUR	100'000.00	02.03.2011	02.03.2018	12 577 632	%	99.010	99.802	02.03.	3.125	3'325.31	N
	CHF	5'000.00	05.03.2009	05.03.2018	2 082 756	%	100.570	100.650	05.03.	2.500	125.00	N
	USD	1'000.00	04.04.2013	04.04.2018	21 046 267	%	99.750	99.549	04.04. 04.10.	1.000	5.007 4.870	N
	USD	1'000.00	15.09.2011	17.09.2018	13 831 144	%	99.980	99.342	17.03. 17.09.	1.875	9.355 9.002	N
	NOK	1'000.00	05.10.2011	05.10.2018	13 987 819	%	101.850	101.118	05.10.	3.500	4.284	N
	USD	1'000.00	20.02.2014	15.04.2019	23 726 279	%	99.710	99.624	15.04. 15.10.	1.750	8.764 8.532	N
	NOK	10'000.00	15.05.2013	22.05.2019	21 358 627	%	101.980	100.740	22.05.	2.250	26.247	N
	USD	1'000.00	23.10.2012	23.10.2019	19 849 608	%	98.800	99.456	23.04. 23.10.	1.375	6.844 6.777	N
	CAD	1'000.00	21.11.2014	21.11.2019	26 094 757	%	99.770	99.824	21.05. 21.11.	1.875	6.705 7.348	N
	AUD	10'000.00	20.01.2015	20.01.2020	26 684 264	%	100.900	99.907	20.01. 20.07.	2.700	103.27 101.39	N
	NOK	10'000.00	17.06.2013	17.06.2020	21 577 188	%	103.590	98.590	17.06.	2.625	30.215	N
	AUD	1'000.00	13.04.2015	13.04.2021	27 849 421	%	100.000	100.000	13.04. 13.10.	2.500	9.500 9.608	N
	CAD	1'000.00	23.07.2014	23.07.2021	24 966 701	%	100.500	101.213	23.07.	2.250	17.021	N
	USD	1'000.00	01.10.2014	01.10.2021	25 557 832	%	99.800	99.339	01.04. 01.10.	2.250	11.284 10.951	N
	AUD	10'000.00	05.03.2015	05.09.2022	27 293 517	%	100.140	99.597	05.03. 05.09.	2.700	102.74 104.35	N
	USD	1'000.00	17.04.2015	17.04.2023	27 865 189	%	97.180	99.720	17.04.	1.875	18.780	N
	USD	1'000.00	13.01.2015	13.01.2025	26 605 463	%	96.590	98.995	13.01. 13.07.	2.000	10.098 9.676	N
	USD	1'000.00	10.06.2015	10.06.2025	28 453 433	%	98.980	99.497	10.06. 10.12.	2.375	11.508 11.763	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Lansforsakringar Hypotek AB, Stockholm, Schweden												
	CHF	5'000.00	29.05.2012	29.05.2019	18 533 497	%	102.100	100.327	29.05.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	11.04.2013	11.04.2023	20 965 498	%	106.100	100.468	11.04.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	16.09.2014	16.09.2024	25 251 192	%	105.850	101.252	16.09.	0.875	43.750	N
LANXESS AG, Leverkusen, Deutschland												
	EUR	1'000.00	23.05.2011	23.05.2018	13 046 600	%	101.680	99.547	23.05.	4.125	45.005	N
	EUR	1'000.00	21.11.2012	21.11.2022	20 018 817	%	110.520	99.023	21.11.	2.625	30.543	N
Leaseplan Corporation NV, Almere-Stad, Niederlande												
	CHF	5'000.00	15.10.2012	15.10.2020	19 552 938	%	102.850	100.895	15.10.	2.375	118.42	N
Leonardo S.p.A., Roma, Italien												
	EUR	1'000.00	12.12.2003	12.12.2018	1 741 240	%	105.440	99.557	12.12.	5.750	66.944	N
	GBP	1'000.00	16.04.2009	16.12.2019	10 109 127	%	109.860	99.022	16.06. 16.12.	8.000	49.693 52.961	N
	EUR	1'000.00	24.03.2005	24.03.2025	2 094 619	%	121.730	99.273	24.03.	4.875	52.213	N
LGT Bank AG, Vaduz, Liechtenstein												
	CHF	5'000.00	02.07.2012	02.07.2019	18 769 555	%	103.500	100.650	02.07.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	10.02.2014	10.05.2021	23 368 020	%	105.600	100.477	10.05.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	08.02.2013	08.02.2023	20 025 283	%	109.500	100.427	08.02.	1.875	93.750	N
	CHF	5'000.00	25.11.2015	25.11.2025	29 947 736	%	102.900	100.630	25.11.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	12.10.2016	12.10.2026	33 833 043	%	99.250	100.322	12.10.	0.200	10.000	N
	CHF	5'000.00	12.05.2017	12.05.2027	36 067 728	%	101.300	100.954		0.500	0.000	N
LGT Finance Limited, George Town, Kaimaninseln												
	CHF	5'000.00	12.05.2010	12.05.2017	11 212 053		-	100.118	12.05.	2.500	125.00	N
Lilly (Eli) and Company, Indianapolis, USA												
	CHF	5'000.00	24.05.2016	24.05.2018	32 373 558	%	100.260	100.300	24.05.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	24.05.2016	24.05.2024	32 373 559	%	100.100	100.040	24.05.	0.150	7.500	N
	CHF	5'000.00	24.05.2016	24.05.2028	32 373 560	%	100.300	100.000	24.05.	0.450	22.500	N
Linde Aktiengesellschaft, München, Deutschland												
	NOK	10'000.00	28.09.2012	28.09.2017	19 634 153		-	99.908	28.09. 28.09.	2.750	33.634 1.125	N
Emissionsdisagio von 0.092% 28.9.2017 Em.preis: 99.908%												
	EUR	1'000.00	17.09.2012	17.09.2020	19 440 717	%	104.860	99.277	17.09.	1.750	20.089	N
	EUR	1'000.00	18.04.2013	18.04.2023	21 144 815	%	108.680	99.302	18.04.	2.000	21.368	N
Linde Finance BV, Amsterdam, Niederlande												
	EUR	1'000.00	24.04.2007	24.04.2017	3 066 963		-	98.751	24.04. 24.04.	4.750	51.364 13.506	N
Emissionsdisagio von 1.249% 24.4.2017 Em.preis: 98.751%												
	EUR	1'000.00	12.12.2011	12.12.2018	14 483 897	%	103.190	99.149	12.12.	3.125	36.382	N
	EUR	1'000.00	11.06.2012	11.06.2019	18 736 343	%	102.780	99.641	11.06.	1.750	18.998	N
	AUD	2'000.00	26.06.2013	20.06.2019	21 698 377	%	102.400	99.660	20.06.	4.250	62.924	N
	EUR	1'000.00	01.06.2011	01.06.2021	13 101 618	%	113.430	99.164	01.06.	3.875	42.169	N
	EUR	1'000.00	22.05.2014	22.05.2024	24 469 257	%	108.980	98.841	22.05.	1.875	20.515	N
Lithuanian Republic, Litauen												
	EUR	1'000.00	29.10.2007	07.02.2018	3 495 304	%	100.440	99.816	07.02.	4.850	51.845	N
	CHF	5'000.00	11.10.2012	11.04.2018	19 612 435	%	100.720	100.278	11.04.	2.000	100.00	N
	EUR	1'000.00	22.10.2015	22.10.2025	30 134 548	%	105.740	98.923	22.10.	1.250	14.473	N
Lloyds Bank PLC, London, Grossbritannien												
	EUR	1'000.00	02.02.2012	02.02.2017	14 868 134		-	99.703	02.02. 02.02.	4.625	49.579 3.175	N
Emissionsdisagio von 0.297% 2.2.2017 Em.preis: 99.703%												
	AUD	10'000.00	28.08.2015	28.08.2018	29 348 874	%	100.390	99.957	28.02. 28.08.	3.100	120.32 116.71	N
	GBP	1'000.00	24.10.2008	24.10.2018	4 736 307	%	104.820	99.242	24.04. 24.10.	6.750	42.810 43.941	N
	GBP	1'000.00	06.04.1993	06.04.2023	62 750	%	135.860	101.854	06.04.	9.625	120.76	N
	GBP	1'000.00	15.04.2009	15.04.2024	10 113 900	%	133.850	99.290	15.04. 15.10.	7.500	47.175 48.691	N
Lloyds Banking Group plc, London, Grossbritannien												
	AUD	10'000.00	22.11.2017	22.11.2027	39 190 572	%	100.100	99.116		4.250	0.000	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	 % %	 Brutto brut lordo CHF	IUP
London Stock Exchange Group PLC, London, Grossbritannien												
	GBP	1'000.00	18.06.2009	18.10.2019	10 272 074	%	114.030	99.548	18.04. 18.10.	VAR.	58.158 58.993	N
Louis Dreyfus Company B.V., Rotterdam, Niederlande												
Notes 2012-Without Fixed Maturity Variable Rate Reg-S Subord. 12.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	12.09.2012	23.09.2017	19 433 284		-	100.000	12.03. 12.09.	8.250	41.532 39.586	N
Ludan Engineering Co., Ltd., Petah Tikva, Israel	EUR	1'000.00	30.07.2013	30.07.2018	21 972 864	%	100.870	99.444	30.07.	3.875	44.082	N
	ILS	1.00	26.02.2015	31.12.2021	27 280 555	%	106.000	100.000	30.06. 31.12.	5.500	0.00748 0.00778	N
Lunar Funding V PLC, Dublin, Irland												
	EUR	1'000.00	30.09.2013	30.09.2020	22 414 210	%	105.260	99.054	30.09.	2.000	22.849	N
	EUR	1'000.00	08.04.2014	08.09.2021	24 075 571	%	106.100	99.076	08.09.	1.875	21.360	N
	EUR	1'000.00	15.09.2015	15.09.2025	29 625 364	%	106.600	99.438	15.09.	1.750	20.104	N
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE, Paris, Frankreich												
Emissionsdisagio von 0.287% 29.6.2017 Em.preis: 99.713%	USD	1'000.00	29.06.2012	29.06.2017	18 924 926		-	99.713	 29.06. 29.06.	1.625	 2.746 7.774	N
	EUR	100'000.00	07.04.2011	06.04.2018	12 808 541	%	101.000	99.784	06.04.	4.000	4'280.20	N
	EUR	1'000.00	02.05.2013	04.11.2019	21 275 820	%	102.650	99.473	04.11.	1.250	14.490	N
	AUD	2'000.00	02.12.2014	02.12.2019	26 174 415	%	102.020	99.377	04.12.	3.500	52.358	N
	EUR	1'000.00	24.09.2014	24.09.2021	25 484 965	%	102.950	99.457	24.09.	1.000	11.501	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Macquarie Bank Ltd, Sydney NSW, Australien												
	CHF	5'000.00	09.08.2012	09.08.2017	19 036 904		-	100.633	09.08.	3.000	150.00	N
	CHF	5'000.00	29.11.2012	29.11.2018	19 954 478	%	102.520	100.311	29.11.	2.125	106.25	N
	USD	1'000.00	29.07.2015	29.07.2020	29 045 295	%	100.520	99.861	29.01. 29.07.	2.850	14.209 13.749	N
	CHF	5'000.00	29.11.2012	29.11.2022	19 954 498	%	114.250	100.564	29.11.	3.000	150.00	N
	CHF	5'000.00	04.03.2015	04.09.2023	26 983 670	%	102.550	100.830	04.09.	0.625	31.250	N
Macquarie Bank Ltd London Branch, London, Grossbritannien												
	CHF	5'000.00	05.02.2016	05.02.2024	31 017 551	%	103.250	100.232	06.02.	0.750	37.500	N
Macquarie Group Limited, Sydney, Australien												
	USD	1'000.00	14.01.2011	14.01.2021	12 284 020	%	109.480	98.941	14.01. 14.07.	6.250	31.593 30.166	N
MAHLE GmbH, Stuttgart, Deutschland												
	EUR	1'000.00	14.05.2014	14.05.2021	24 432 229	%	105.680	99.727	14.05.	2.500	27.353	N
	EUR	1'000.00	20.05.2015	20.05.2022	28 266 038	%	106.010	99.682	20.05.	2.375	25.986	N
MAN SE, München, Deutschland												
Emissionsdisagio von 0.323% 13.3.2017 Em.preis: 99.677%	EUR	1'000.00	13.03.2012	13.03.2017	18 133 983		-	99.677	13.03. 13.03.	2.125	22.826 3.469	N
Manpower Inc Doing Business As ManpowerGroup, Milwaukee, USA												
	EUR	1'000.00	22.06.2012	22.06.2018	18 832 495	%	102.180	99.974	22.06.	4.500	48.813	N
Marathon Oil Corporation, Houston, USA												
	USD	1'000.00	10.06.2015	01.06.2020	28 438 153	%	100.120	99.783	01.06. 01.12.	2.700	13.087 13.286	N
Massachusetts Water Resources Authority, Charlestown, USA												
	USD	5'000.00	06.05.2010	01.08.2027	12 005 267	%	109.920	109.647	01.02. 01.08.	5.000	124.04 120.70	N
Mastellone Hermanos S.A, General Rodriguez, Argentinien												
	USD	1.00	03.07.2014	03.07.2021	24 803 927	%	105.130	100.000	03.01. 03.07.	12.625	0.06495 0.06079	N
Matterhorn Telecom S.A., Luxemburg												
	CHF	1'000.00	23.04.2015	01.05.2022	27 927 027	%	101.010	100.000	01.05. 01.11.	3.625	18.125 18.125	N
MBIA Global Funding LLC, Armonk, USA												
	CHF	5'000.00	07.02.2007	07.02.2017	2 860 361		-	100.350	07.02.	2.750	137.50	N
McDonald's Corporation, Oak Brook, USA												
Tranche 111	USD	1'000.00	29.05.2012	29.05.2019	18 679 488	%	99.530	99.045	29.05. 29.11.	1.875	9.152 9.226	N
	EUR	100'000.00	17.02.2011	17.02.2021	12 489 131	%	111.620	99.016	17.02.	4.000	4'267.86	N
	EUR	100'000.00	03.05.2016	15.11.2023	32 413 991	%	101.460	99.282	15.11.	1.000	1'167.95	N
	CHF	5'000.00	05.10.2016	04.10.2024	33 833 045	%	99.700	100.000	04.10.	0.170	8.476	N
	EUR	100'000.00	27.11.2012	27.11.2024	20 068 516	%	109.720	99.557	27.11.	2.375	2'776.61	N
Meda AB, Solna, Schweden												
Emissionsdisagio von 0.473% Rückzahlungsagio von 1.625% 15.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	SEK	1'000'000.00	21.05.2014	21.05.2019	24 479 461		-	99.527	21.02. 22.05. 21.08. 21.11. 15.12. 15.12. 15.12.	VAR.	309.87 322.57 353.14 373.08 79.223 552.15 1'896.92	N
Mediobanca - Banca di Credito Finanziario S.p.A., Milano, Italien												
	EUR	1'000.00	31.05.2011	31.05.2017	13 133 737		-	100.000	28.02. 31.05.	VAR.	9.039 9.662	N
	USD	2'000.00	02.10.2014	02.10.2019	25 637 853	%	100.737	100.000	02.10.	3.000	58.407	N
	EUR	1'000.00	18.04.2013	18.04.2023	21 225 780	%	116.600	100.000	18.04.	5.750	61.433	N
Mercedes-Benz Australia/Pacific Pty Ltd, Mulgrave, Australien												
	AUD	2'000.00	24.01.2014	24.01.2017	23 417 804		-	100.793	24.01.	3.750	57.000	N
	AUD	2'000.00	07.04.2014	07.04.2017	24 064 494		-	100.836	07.04.	3.750	56.700	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	AUD	2'000.00	23.06.2014	23.06.2017	24 684 534		-	101.038	23.06.	3.625	53.172	N
	AUD	2'000.00	18.08.2014	18.08.2017	25 134 440		-	99.789	18.08.	3.375	51.364	N
Emissionsdisagio von 0.211% 18.8.2017 Em.preis: 99.789%									18.08.		3.211	
	AUD	2'000.00	10.11.2014	10.11.2017	25 949 297		-	100.925	10.11.	3.250	49.622	N
	AUD	2'000.00	16.01.2015	16.01.2018	26 643 802	%	100.020	100.705	16.01.	2.750	41.680	N
	AUD	2'000.00	13.03.2015	13.03.2018	27 390 358	%	100.030	100.799	13.03.	2.500	38.166	N
	AUD	2'000.00	15.06.2015	15.06.2018	28 453 058	%	100.130	100.876	15.06.	2.625	38.811	N
	AUD	2'000.00	19.11.2015	19.11.2018	30 442 645	%	100.780	100.955	19.11.	3.250	48.667	N
	AUD	2'000.00	23.05.2016	23.05.2019	32 578 361	%	100.430	101.058	23.05.	2.750	40.042	N
	AUD	2'000.00	15.11.2016	15.11.2019	34 514 577	%	99.960	100.830	15.11.	2.500	37.522	N
	AUD	2'000.00	09.03.2017	09.03.2020	35 927 504	%	100.380	101.035		2.875	0.000	N
	AUD	2'000.00	23.06.2017	23.06.2020	37 084 712	%	99.850	101.118		2.625	0.000	N
	AUD	2'000.00	24.11.2017	24.11.2020	39 172 355	%	99.640	99.813		2.625	0.000	N
Merck & Co., Inc., Kenilworth, USA												
	USD	1'000.00	20.05.2013	18.05.2018	21 435 634	%	99.830	99.769	18.05.	1.300	6.359	N
									18.11.		6.441	
	EUR	1'000.00	15.10.2014	15.10.2021	25 654 729	%	103.290	99.873	15.10.	1.125	12.942	N
	USD	1'000.00	10.02.2015	10.02.2022	27 079 219	%	99.600	99.865	10.02.	2.350	11.807	N
									10.08.		11.325	
	USD	1'000.00	13.09.2012	15.09.2022	19 493 226	%	99.310	99.965	15.03.	2.400	12.097	N
									15.09.		11.523	
	USD	1'000.00	20.05.2013	18.05.2023	21 435 632	%	100.570	99.913	18.05.	2.800	13.698	N
									18.11.		13.874	
	USD	1'000.00	20.05.2013	18.05.2043	21 435 638	%	109.740	99.694	18.05.	4.150	20.302	N
									18.11.		20.564	
Merck Financial Services GmbH, Darmstadt, Deutschland												
	EUR	1'000.00	01.09.2015	02.09.2019	29 484 406	%	101.310	99.851	02.09.	0.750	8.542	N
	EUR	1'000.00	24.03.2010	24.03.2020	11 147 594	%	110.190	99.582	24.03.	4.500	48.197	N
	EUR	1'000.00	01.09.2015	01.09.2022	29 476 970	%	104.980	99.649	01.09.	1.375	15.723	N
Merck KGaA, Darmstadt, Deutschland												
	EUR	1'000.00	12.12.2014	12.12.2074	26 358 446	%	110.720	100.000	12.12.	3.375	39.293	N
	EUR	1'000.00	12.12.2014	12.12.2074	26 358 129	%	106.010	99.274	12.06.	2.625	28.498	N
METRO AG, Düsseldorf, Deutschland												
	EUR	1'000.00	01.03.2012	01.03.2019	18 059 344	%	103.710	99.712	01.03.	3.375	35.943	N
	EUR	1'000.00	28.10.2014	28.10.2021	25 856 116	%	103.830	99.247	28.10.	1.375	15.939	N
	EUR	1'000.00	19.03.2015	19.03.2025	27 447 621	%	101.140	99.834	19.03.	1.500	16.076	N
Metro Finance BV, Venlo, Niederlande												
	EUR	1'000.00	22.02.2010	22.02.2017	11 025 007		-	99.899	22.02.	4.250	45.461	N
Emissionsdisagio von 0.101% 22.2.2017 Em.preis: 99.899%									22.02.		1.077	
	EUR	1'000.00	11.12.2012	11.05.2018	20 184 175	%	100.760	99.488	11.05.	2.250	24.622	N
Metropolitan Life Global Funding I, Wilmington, USA												
	CHF	5'000.00	17.04.2014	17.04.2019	24 163 492	%	101.580	100.377	17.04.	0.750	37.500	N
	CHF	5'000.00	18.06.2013	18.06.2020	21 569 040	%	103.400	100.066	18.06.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	18.09.2014	19.09.2022	25 428 220	%	104.800	100.699	19.09.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	19.01.2017	19.01.2026	34 755 688	%	100.400	100.200		0.300	0.000	N
mFinance France S.A., 92300 LEVALLOIS PERRET, Frankreich												
	CHF	5'000.00	08.10.2013	08.10.2018	22 241 826	%	102.240	100.296	08.10.	2.500	125.00	N
	CHF	5'000.00	28.03.2017	28.03.2023	35 991 543	%	102.300	100.000		1.005	0.000	N
Michelin Luxembourg SCS, Luxemburg												
	EUR	1'000.00	20.06.2012	20.06.2019	18 817 228	%	104.010	99.912	20.06.	2.750	29.860	N
Microsoft Corporation, Redmond, USA												
	USD	1'000.00	18.05.2009	01.06.2019	10 191 514	%	102.990	99.950	01.06.	4.200	20.358	N
									01.12.		20.667	
	USD	1'000.00	06.02.2017	06.02.2020	35 553 728	%	99.370	99.933	06.08.	1.850	8.994	N
	USD	1'000.00	08.02.2011	08.02.2021	12 457 270	%	105.090	99.747	08.02.	4.000	19.868	N
									08.08.		19.523	
	USD	1'000.00	12.02.2015	12.02.2022	27 108 965	%	99.820	99.827	12.02.	2.375	11.935	N
									12.08.		11.520	
	EUR	1'000.00	06.12.2013	06.12.2028	23 056 711	%	121.340	99.223	06.12.	3.125	36.464	N
	USD	1'000.00	27.09.2010	01.10.2040	11 795 475	%	116.510	98.911	01.04.	4.500	22.568	N
									01.10.		21.902	

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Minera y Metalurgica del Boleo SAPI de CV, Mexiko												
	CHF	5'000.00	12.11.2014	12.11.2019	25 428 164	%	100.900	100.646	12.11.	0.750	37.500	N
Mitsubishi Corporation, Tokyo, Japan												
	USD	1'000.00	13.07.2012	13.07.2017	19 010 305		-	99.488	13.01. 13.07. 13.07.	1.875	9.467 9.072 4.954	N
Emissionsdisagio von 0.512% 13.7.2017 Em.preis: 99.488%												
MOL Hungarian Oil and Gas Plc, Budapest, Ungarn												
	EUR	1'000.00	28.04.2016	28.04.2023	32 368 316	%	107.970	99.214	28.04.	2.625	28.455	N
Mondelêz International, Inc., Northfield, USA												
	CHF	5'000.00	30.03.2015	30.03.2017	27 475 881		-	100.000	30.03.	0.000	0.000	N
	USD	1'000.00	13.08.2007	11.08.2017	3 325 950		-	99.414	11.02. 11.08. 11.08.	6.500	32.665 31.289 5.641	N
Emissionsdisagio von 0.586% 11.8.2017 Em.preis: 99.414%												
	CHF	5'000.00	26.01.2016	26.01.2018	31 017 553	%	100.040	100.000	26.01.	0.080	4.000	N
	USD	1'000.00	12.12.2007	01.02.2018	3 613 481	%	99.730	99.515	01.02. 01.08.	6.125	30.390 29.573	N
	GBP	1'000.00	18.07.2008	18.07.2018	4 413 184	%	103.120	99.587	18.01. 18.07.	7.250	45.183 44.607	N
	USD	1'000.00	22.05.2008	23.08.2018	4 256 351	%	102.400	99.126	23.02. 23.08.	6.125	30.801 29.550	N
	CHF	5'000.00	30.03.2017	30.03.2020	36 017 268	%	100.000	100.000		0.050	0.000	N
	CHF	5'000.00	06.10.2015	06.10.2020	29 778 287	%	101.650	100.468	06.10.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	30.03.2015	30.12.2021	27 475 882	%	101.850	100.625	30.12.	0.625	31.250	N
	CHF	5'000.00	26.01.2016	26.07.2022	31 017 554	%	102.400	100.064	26.07.	0.650	32.500	N
	CHF	5'000.00	06.10.2015	21.12.2023	29 778 295	%	104.750	100.299	21.12.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	30.03.2017	30.09.2024	36 017 269	%	100.800	100.000	30.09.	0.617	15.425	N
	CHF	5'000.00	30.03.2015	30.12.2025	27 475 883	%	104.000	100.982	30.12.	1.125	56.250	N
Montana Tech Components GmbH, Wien, Österreich												
	EUR	1'000.00	06.06.2012	06.06.2017	18 681 764		-	101.400	06.06.	5.000	54.277	N
Morgan Stanley, New York, USA												
	EUR	50'000.00	16.01.2007	16.01.2017	2 871 028		-	100.000	17.01.	VAR.	14.936	N
	EUR	1'000.00	02.10.2007	02.10.2017	3 435 842		-	99.594	02.10. 02.10.	5.500	62.834 4.638	N
Emissionsdisagio von 0.406% 2.10.2017 Em.preis: 99.594%												
	EUR	1'000.00	12.03.2013	12.03.2018	20 881 331	%	100.480	99.487	12.03.	2.250	24.169	N
	AUD	1'000.00	16.05.2013	16.11.2018	21 372 840	%	101.870	100.000	16.05. 16.11.	4.750	17.285 18.063	N
	CHF	5'000.00	21.11.2006	21.11.2018	2 753 915	%	103.330	100.449	21.11.	3.125	156.25	N
	USD	1'000.00	23.07.2014	23.07.2019	24 981 136	%	99.940	99.565	23.01. 23.07.	2.375	11.859 11.234	N
	USD	1'000.00	23.04.2015	23.04.2027	27 974 167	%	102.160	99.640	23.04. 23.10.	3.950	19.661 19.470	N
Motability Operations Group PLC, London, Grossbritannien												
	GBP	1'000.00	30.04.2009	10.12.2019	10 136 880	%	111.040	99.865	10.06. 10.12.	6.625	40.576 43.955	N
27.2.2017 Rückkauf ausstehender Titel												
	GBP	1'000.00	28.01.2010	28.06.2022	10 920 604	%	117.940	99.193	28.06. 28.12.	5.375	33.295 35.454	N
Muenchener Hypothekenbank eG, Muenchen, Deutschland												
	CHF	5'000.00	12.06.2007	12.06.2017	3 097 029		-	101.055	12.06.	3.000	150.00	N
	CHF	5'000.00	13.10.2017	20.12.2024	38 412 504	%	100.050	100.000	20.12.	0.300	2.791	N
	CHF	5'000.00	22.11.2017	22.11.2032	38 694 931	%	101.600	100.504		0.550	0.000	N
Multibank Inc., Panama City, Panama												
	CHF	5'000.00	11.07.2017	11.01.2021	36 869 773	%	100.450	100.000		2.000	0.000	N
Municipality Finance Plc, Helsinki, Finnland												
	CHF	5'000.00	26.03.2010	26.05.2017	11 079 854		-	100.576	26.05.	1.750	87.500	N
	CHF	5'000.00	07.02.2011	07.02.2018	12 295 617	%	100.230	100.697	07.02.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	10.02.2010	10.12.2019	10 914 137	%	105.650	101.058	10.12.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	15.04.2009	15.04.2021	10 026 206	%	111.350	100.750	15.04.	3.000	150.00	N
	CHF	5'000.00	01.02.2013	01.02.2023	20 369 562	%	105.850	100.441	01.02.	0.875	43.750	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF		IUP
	CHF	5'000.00	17.09.2014	17.09.2024	25 188 579	%	105.850	101.328	17.09.	0.750	37.500		N
	CHF	5'000.00	30.03.2011	30.03.2026	12 611 653	%	119.400	101.225	30.03.	2.375	118.75		N
	CHF	5'000.00	08.06.2012	08.06.2027	18 590 708	%	112.350	101.450	08.06.	1.375	68.750		N
	CHF	5'000.00	08.08.2017	06.08.2038	36 153 312	%	102.650	100.810		0.625	0.000		N
Myriad International Holdings B.V., Niederlande													
	USD	1'000.00	21.07.2015	21.07.2025	28 941 207	%	108.810	99.962	23.01. 21.07.	5.500	27.464 25.765		N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
NASDAQ, Inc., New York, USA												
	EUR	1'000.00	07.06.2013	07.06.2021	21 577 000	%	111.790	99.831	07.06.	3.875	42.061	N
National Australia Bank Limited, Melbourne, Australien												
	CHF	5'000.00	03.02.2011	03.02.2017	12 264 456		-	100.305	03.02.	2.125	106.25	N
	AUD	1'000.00	06.03.2012	06.03.2017	18 066 040		-	100.563	06.03.	6.000	46.043	N
	CHF	5'000.00	14.07.2010	14.07.2017	11 451 142		-	100.476	14.07.	2.250	112.50	N
	AUD	1'000.00	08.08.2012	08.08.2017	19 183 723		-	101.108	08.08.	5.000	38.535	N
	GBP	1'000.00	08.11.2010	08.11.2017	11 973 984		-	99.529	08.11.	3.625	47.491	N
Emissionsdisagio von 0.471% 8.11.2017 Em.preis: 99.529%									08.11.		6.170	
	CAD	2'000.00	12.12.2013	12.12.2017	23 057 459		-	101.524	12.12.	2.250	34.686	N
	NZD	1'000.00	25.01.2013	25.01.2018	20 455 991	%	99.960	101.210	25.01.	4.125	30.019	N
Tranche 2	AUD	1'000.00	03.04.2013	03.04.2018	21 005 767	%	100.600	101.085	03.04.	4.375	33.348	N
	AUD	1'000.00	23.05.2013	23.05.2018	21 436 544	%	100.720	99.966	23.05.	4.000	14.441	N
									23.11.		15.092	
	AUD	1'000.00	20.09.2012	20.09.2018	19 534 700	%	101.960	101.052	20.09.	5.000	38.801	N
	CHF	5'000.00	07.08.2012	07.11.2018	18 893 193	%	101.550	100.257	07.11.	1.125	56.250	N
	AUD	1'000.00	22.01.2013	22.01.2019	20 434 038	%	102.280	100.987	22.01.	4.500	34.158	N
	NZD	1'000.00	28.03.2014	28.03.2019	24 027 135	%	103.570	101.346	28.03.	5.375	37.199	N
	AUD	1'000.00	20.05.2014	20.05.2019	24 452 349	%	100.670	100.000	20.02.	VAR.	4.999	N
	AUD	1'000.00	20.05.2014	20.05.2019	24 452 105	%	102.510	99.911	20.05.	4.250	15.345	N
									20.11.		16.041	
Tranche 2	AUD	1'000.00	06.06.2013	06.06.2019	21 497 237	%	102.410	100.797	06.06.	4.125	29.884	N
	AUD	1'000.00	10.09.2013	10.09.2019	22 248 529	%	103.720	100.000	10.09.	4.750	36.304	N
	NZD	1'000.00	22.11.2013	22.11.2019	22 881 706	%	105.320	101.106	22.11.	5.625	37.911	N
	AUD	1'000.00	25.11.2013	25.11.2019	22 908 279	%	104.360	100.998	25.11.	4.750	35.501	N
	AUD	1'000.00	27.08.2014	27.11.2019	25 279 193	%	102.930	99.690	27.05.	4.000	14.411	N
									27.11.		15.071	
	AUD	1'000.00	17.01.2014	17.01.2020	23 273 301	%	104.700	101.625	17.01.	5.000	37.913	N
	NZD	1'000.00	25.02.2015	25.02.2020	27 138 232	%	102.820	100.580	25.02.	4.250	30.928	N
	CHF	5'000.00	12.04.2013	17.04.2020	21 038 413	%	103.000	100.720	17.04.	1.000	50.000	N
	NZD	1'000.00	15.09.2014	15.09.2020	25 389 324	%	105.510	101.141	15.09.	5.125	35.826	N
	EUR	1'000.00	12.11.2013	12.11.2020	22 821 321	%	105.050	99.214	12.11.	2.000	23.224	N
	AUD	1'000.00	07.02.2014	07.05.2021	23 540 104	%	106.740	101.510	07.05.	5.000	36.836	N
	CHF	5'000.00	10.07.2014	10.12.2021	24 586 583	%	104.450	100.697	10.12.	1.000	50.000	N
	EUR	1'000.00	20.01.2015	20.01.2022	26 644 226	%	102.210	99.615	20.01.	0.875	9.418	N
	CHF	5'000.00	05.08.2015	05.08.2022	28 931 639	%	101.650	100.173	05.08.	0.350	17.500	N
	CHF	5'000.00	19.01.2016	19.01.2023	30 976 185	%	101.050	100.295	19.01.	0.250	12.500	N
	CHF	5'000.00	05.03.2013	05.09.2023	20 447 725	%	108.750	100.925	05.09.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	07.02.2014	07.02.2024	23 391 198	%	110.500	100.378	07.02.	1.500	75.000	N
	AUD	1'000.00	11.12.2017	11.12.2024	39 413 747	%	99.140	99.994		3.250	0.000	N
	CHF	5'000.00	31.01.2017	31.10.2025	34 682 843	%	100.250	100.362	31.10.	0.300	11.250	N
National Bank of Canada, Montreal, Kanada												
	CAD	1'000.00	03.03.2015	03.03.2020	27 373 206	%	99.020	100.000	03.03.	1.742	6.507	N
									03.09.		6.762	
National Company Kazakhstan Temir Zholy JSC, Astana, Kasachstan												
	CHF	5'000.00	20.06.2014	20.06.2019	24 619 803	%	101.000	100.000	20.06.	2.590	129.50	N
	CHF	5'000.00	20.06.2014	20.06.2022	24 619 905	%	104.700	100.000	20.06.	3.638	181.90	N
National Express Group PLC, Birmingham, Grossbritannien												
	GBP	1'000.00	17.06.2010	17.06.2020	11 429 249	%	112.120	98.928	17.06.	VAR.	82.308	N
National Grid Electricity Transmission Plc, London, Grossbritannien												
	CAD	1'000.00	20.09.2012	20.09.2017	19 551 250		-	100.000	20.03.	2.730	10.101	N
									20.09.		10.804	
National Grid Gas Plc, London, Grossbritannien												
	GBP	1'000.00	30.01.2002	07.06.2017	1 357 375		-	99.291	07.06.	6.000	74.940	N
Emissionsdisagio von 0.709% 7.6.2017 Em.preis: 99.291%									07.06.		8.855	
	GBP	50'000.00	03.03.2008	03.03.2020	3 810 752	%	111.720	99.128	03.03.	6.375	3'949.73	N
	GBP	1'000.00	13.05.2008	13.05.2038	4 232 641	%	151.020	98.523	13.05.	6.000	77.243	N
National Grid North America Inc, Waltham, USA												
	EUR	100'000.00	20.02.2013	20.02.2018	20 710 728	%	100.250	99.796	20.02.	1.750	1'867.80	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
National Grid plc, London, Grossbritannien												
	EUR	1'000.00	02.07.2003	02.07.2018	1 623 677	%	102.000	98.867	02.07.	5.000	54.742	N
	EUR	1'000.00	10.03.2005	10.03.2020	2 083 397	%	109.410	98.935	10.03.	4.375	47.096	N
National Westminster Bank PLC, London, Grossbritannien												
Euro Medium Term-Notes 1999-Without Fixed Maturity VRN Reg-S Series R113 Subord.	EUR	1'000.00	05.10.1999		1 002 826	%	96.160	99.651	05.01.	VAR.	5.064	N
									05.04.		4.903	
									05.07.		5.034	
									05.10.		5.326	
Nationwide Building Society, Swindon, Grossbritannien												
6.875 % Reset Perpetual Contingent Convertible 2014-Open end Tier 1 Capital Securities	GBP	1'000.00	11.03.2014		23 875 099	%	104.700	100.014	20.06.	6.875	42.211	N
									20.12.		45.501	
	GBP	1'000.00	09.09.2009	09.09.2019	10 522 258	%	107.510	99.525	09.03.	5.625	34.383	N
									09.09.		35.594	
Natural Resource Partners LP / NRP Fin Corp., USA												
	USD	1'000.00	01.04.2014	01.10.2018	24 451 984		-	99.007	01.04.	9.125	45.764	N
									01.10.		44.413	
									02.10.		0.24674	
Emissionsdisagio von 0.993% 2.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung									02.10.		9.666	
Navient Corp, Newark, DE, USA												
	USD	1'000.00	16.12.2013	17.06.2019	23 121 988	%	102.250	99.405	17.06.	4.875	23.738	N
									17.12.		24.022	
Nederlandse Waterschapsbank N.V., 's-Gravenhage, Niederlande												
	EUR	1'000.00	23.01.2007	23.01.2017	2 885 888		-	99.102	23.01.	4.125	44.392	N
Emissionsdisagio von 0.898% 23.1.2017 Em.preis: 99.102%									23.01.		9.637	
	EUR	1'000.00	14.01.2010	01.02.2017	10 898 596		-	99.985	01.02.	3.375	36.131	N
Emissionsdisagio von 0.015% 1.2.2017 Em.preis: 99.985%									01.02.		0.16014	
Tranche 4 Reg S	USD	1'000.00	09.02.2012	09.02.2017	14 931 139		-	99.797	09.02.	2.125	10.632	N
Emissionsdisagio von 0.203% 9.2.2017 Em.preis: 99.797%									09.02.		2.031	
	NOK	1'000.00	03.04.2012	03.04.2017	18 297 187		-	101.241	03.04.	3.375	3.936	N
	SEK	10'000.00	24.04.2012	24.04.2017	18 396 810		-	100.355	24.04.	2.750	30.915	N
	NZD	1'000.00	26.07.2012	26.07.2017	19 039 459		-	101.120	26.07.	4.250	30.292	N
	CHF	5'000.00	10.02.2010	10.10.2017	10 879 205		-	100.228	10.10.	2.000	100.00	N
	EUR	1'000.00	22.01.2008	22.01.2018	3 701 994	%	100.250	99.920	22.01.	4.375	47.083	N
	CAD	1'000.00	22.01.2013	22.01.2018	20 434 768	%	99.950	101.501	22.01.	2.125	15.996	N
	AUD	1'000.00	24.01.2013	24.01.2018	20 445 234	%	99.970	101.403	24.01.	4.000	30.400	N
	CHF	5'000.00	01.02.2012	01.02.2018	14 282 144	%	100.140	100.446	01.02.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	27.12.2006	27.12.2018	2 798 217	%	103.180	101.105	27.12.	2.500	125.00	N
	EUR	1'000.00	23.08.2012	23.08.2019	19 315 479	%	103.460	99.349	23.08.	1.625	18.525	N
	CHF	5'000.00	03.03.2010	03.09.2019	10 998 711	%	105.300	100.427	03.09.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	03.08.2010	03.02.2020	11 501 322	%	105.250	100.711	03.02.	1.875	93.750	N
	EUR	1'000.00	17.02.2005	17.02.2020	2 064 519	%	109.180	99.086	17.02.	3.875	41.344	N
	CHF	5'000.00	19.08.2005	19.08.2020	2 223 560	%	107.650	100.405	19.08.	2.375	118.75	N
	EUR	1'000.00	14.01.2011	14.01.2021	12 292 475	%	111.420	99.362	14.01.	3.500	37.627	N
	CHF	5'000.00	24.02.2011	24.02.2021	12 420 553	%	108.500	100.901	24.02.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	07.02.2007	07.02.2022	2 860 819	%	112.700	100.810	07.02.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	27.01.2006	27.01.2023	2 396 032	%	113.300	101.130	27.01.	2.375	118.75	N
	CHF	5'000.00	09.08.2012	09.08.2024	19 036 102	%	108.950	100.695	09.08.	1.250	62.500	N
	CHF	5'000.00	13.09.2012	13.09.2027	19 012 503	%	112.450	100.815	13.09.	1.375	68.750	N
	CHF	5'000.00	07.08.2006	07.08.2029	2 623 349	%	134.100	101.800	07.08.	3.250	162.50	N
	CHF	5'000.00	21.08.2017	21.08.2037	36 153 311	%	102.550	100.706		0.625	0.000	N
Nestle Finance International Ltd, Luxemburg												
	AUD	2'000.00	29.03.2012	29.03.2017	18 206 109		-	100.838	29.03.	4.625	70.641	N
	EUR	1'000.00	19.07.2012	19.07.2019	19 043 214	%	102.610	99.572	19.07.	1.500	16.488	N
	EUR	1'000.00	12.09.2013	10.09.2021	22 292 844	%	107.600	99.709	10.09.	2.125	24.243	N
	EUR	1'000.00	12.09.2012	12.09.2022	19 423 449	%	107.490	98.996	12.09.	1.750	20.075	N
	EUR	1'000.00	16.11.2015	16.05.2023	30 352 455	%	102.450	99.040	16.05.	0.750	8.206	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	GBP	1'000.00	30.11.2012	30.11.2023	20 120 600	%	105.200	99.421	30.11.	2.250	29.907	N
Nestlé Holdings Inc., Glendale, USA												
	USD	1'000.00	21.06.2012	21.06.2017	18 850 448		-	99.857	21.06. 21.06.	1.375	13.403 1.393	N
Emissionsdisagio von 0.143% 21.6.2017 Em.preis: 99.857%												
	NOK	10'000.00	10.07.2012	10.07.2017	18 947 345		-	101.185	10.07.	2.500	28.968	N
	AUD	1'000.00	13.07.2012	13.10.2017	18 986 998		-	100.000	13.10.	4.000	30.747	N
	NOK	10'000.00	20.11.2012	20.11.2017	20 028 825		-	101.578	20.11.	2.250	26.922	N
	USD	1'000.00	16.10.2012	16.01.2018	19 791 672	%	99.970	99.916	17.01.	1.250	12.533	N
	AUD	2'000.00	18.01.2013	18.01.2018	20 434 030	%	99.930	101.464	18.01.	3.750	56.979	N
	CHF	5'000.00	14.02.2007	14.02.2018	2 864 464	%	100.390	100.960	14.02.	2.625	131.25	N
	AUD	2'000.00	19.03.2013	19.07.2018	20 906 147	%	100.920	100.903	19.07.	3.875	58.722	N
	USD	1'000.00	24.01.2013	24.07.2018	20 504 153	%	99.640	99.576	24.07.	1.375	13.007	N
	AUD	2'000.00	06.12.2013	06.12.2018	23 002 903	%	101.570	100.986	06.12.	4.125	61.851	N
	USD	1'000.00	12.09.2013	12.03.2019	22 276 613	%	100.180	99.411	12.03.	2.250	22.653	N
	USD	1'000.00	02.12.2014	30.09.2019	26 162 227	%	99.680	99.897	30.09.	2.000	19.469	N
	USD	1'000.00	11.06.2013	11.12.2019	21 579 212	%	99.910	99.229	11.12.	2.000	19.811	N
	USD	1'000.00	14.05.2014	14.01.2020	24 410 020	%	99.720	99.456	14.01.	2.125	21.483	N
	AUD	2'000.00	18.03.2014	18.03.2020	23 942 555	%	103.920	99.335	18.03.	4.250	65.510	N
	NOK	10'000.00	15.04.2014	15.04.2020	24 150 421	%	103.870	101.352	15.04.	2.750	32.276	N
	AUD	2'000.00	03.11.2014	03.11.2020	25 866 928	%	102.620	101.133	03.11.	3.625	55.470	N
	USD	1'000.00	09.03.2016	09.03.2021	31 797 189	%	98.500	99.568	09.03.	1.875	19.022	N
	GBP	1'000.00	11.12.2017	11.06.2021	39 377 576	%	99.910	99.588		1.000	0.000	N
	USD	1'000.00	13.07.2016	13.07.2021	33 202 558	%	96.610	99.534	13.07.	1.375	13.305	N
	USD	1'000.00	10.05.2017	10.05.2022	36 621 704	%	98.940	99.780		2.250	0.000	N
Tranche 1	CHF	5'000.00	04.10.2017	04.10.2027	38 310 433	%	100.650	100.420		0.250	0.000	N
Tranche 2	CHF	5'000.00	04.10.2017	04.10.2032	38 310 434	%	100.400	100.432		0.550	0.000	N
Netflix, Inc., Los Gatos, USA												
	USD	1'000.00	01.09.2014	01.03.2024	27 329 080	%	106.280	100.000	01.03. 01.09.	5.750	29.005 27.675	N
Network Rail Infrastructure Finance, London, Grossbritannien												
	GBP	1'000.00	21.07.2005	21.07.2020	2 223 249	%	109.960	99.769	21.07.	4.625	56.917	N
	CHF	5'000.00	06.10.2006	06.10.2021	2 695 007	%	111.800	101.096	06.10.	2.750	137.50	N
	GBP	1'000.00	20.01.2005	22.01.2024	2 046 760	%	121.190	99.444	22.01.	4.750	59.416	N
NEW AREVA HOLDING, Frankreich												
	EUR	100'000.00	20.03.2014	20.03.2023	23 957 794	%	104.010	99.491	20.03.	3.125	3'349.21	N
New South Wales Treasury Corp, Sydney, Australien												
	AUD	10'000.00	23.11.1990	23.11.2020	638 844	%	93.760	2.750		0.000	0.000	Y
New York Life Global Funding, New York, USA	CHF	5'000.00	26.04.2011	26.04.2041	12 632 535	%	131.700	101.634	26.04.	2.375	118.75	N
	CHF	5'000.00	13.05.2014	13.05.2019	24 348 381	%	101.310	100.339	13.05.	0.500	25.000	N
New Zealand, Neuseeland	CHF	5'000.00	02.02.2015	02.02.2022	26 702 004	%	101.850	100.779	02.02.	0.375	18.750	N
	NZD	1.00	27.04.2005	15.12.2017	2 142 783		-	100.000	15.06. 15.12.	6.000	0.02101 0.0209	N
New Zealand Local Government Funding Agency Ltd, Wellington, Neuseeland	NZD	1'000.00	15.04.2013	15.04.2020	21 137 858	%	102.390	100.000	15.04. 15.10.	3.000	10.540 10.532	N
	NZD	1.00	11.06.2012	15.03.2019	19 348 688	%	103.270	100.000	15.03. 15.09.	5.000	0.01738 0.01761	N
Newcrest Finance Property Ltd, Melbourne, Australien												
	USD	1'000.00	15.11.2011	15.11.2021	14 287 397	%	104.790	99.880	15.05. 15.11.	4.450	22.174 22.020	N
Newton Acquisition Inc., Dallas, USA												
	USD	1'000.00	27.05.1998	01.06.2028	975 922	%	76.100	99.814	01.06. 01.12.	7.125	34.536 35.060	N
Nexans, Courbevoie, Frankreich												
	EUR	100'000.00	19.12.2012	19.03.2018	20 260 324	%	100.740	99.398	20.03.	4.250	4'567.41	N
NIBC Bank NV, 's-Gravenhage, Niederlande												
	CHF	5'000.00	17.06.2016	17.06.2019	32 542 919	%	101.500	100.073	17.06.	1.375	68.750	N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Nissan Motor Acceptance Corp, Nashville, USA												
	USD	1'000.00	18.03.2013	15.03.2018	20 937 356	%	99.980	99.777	15.03. 15.09.	1.800	9.072 8.642	N
NN Group Bidco B.V., 's-Gravenhage, Niederlande												
Fixed-to-Floating Rate Undated Subordinated Notes 2014-Without Fixed Maturity Variable Rate Reg-S S2	EUR	1'000.00	13.06.2014		24 658 826	%	111.750	99.492	13.06.	4.375	47.470	N
NN Group N.V., Amsterdam, Niederlande												
Emissionsdisagio von 0.895% 8.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	10'000.00	07.05.2002	07.05.2027	1 414 981		-	99.105	08.05. 08.05.	6.375	695.09 97.586	N
Nobassil Vermoegensverwaltung GmbH, Berlin, Deutschland												
	CHF	1'000.00	20.07.2017	20.07.2022	37 589 553	%	100.000	100.000		4.000	0.000	N
Noble Group Limited, Bermuda												
	USD	1'000.00	29.10.2009	29.01.2020	10 686 757	%	37.380	99.105	30.01. 29.07.	6.750	33.653 32.383	N
Nokia Corporation, Espoo, Finnland												
	EUR	1'000.00	04.02.2009	04.02.2019	1 500 713	%	106.900	99.702	04.02.	6.750	72.161	N
30.5.2017 Rückkauf ausstehender Titel	USD	1'000.00	07.05.2009	15.05.2019	10 162 839	%	103.400	99.075	15.05. 15.11.	5.375	26.784 26.598	N
Nomos Capital Plc, Grossbritannien												
	USD	1'000.00	26.04.2012	26.04.2019	18 462 409	%	17.000	100.000	26.04. 26.10.	10.000	49.733 49.824	N
Norddeutsche Landesbank Girozentrale, Hannover, Deutschland												
	EUR	1'000.00	24.09.2015	24.09.2018	29 747 481	%	100.420	99.930	24.09.	0.625	7.188	N
2.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	02.10.2015	02.10.2023	29 535 561		-	100.000	02.10.	0.750	8.568	N
Nordea Bank AB, Stockholm, Schweden												
	CHF	5'000.00	29.03.2012	29.09.2017	18 000 616		-	100.403	29.09.	1.500	75.000	N
	EUR	1'000.00	12.04.2013	12.04.2018	21 122 526	%	100.090	99.938	12.04.	1.375	14.674	N
	CHF	5'000.00	25.03.2013	25.09.2018	20 796 064	%	101.190	100.588	25.09.	0.875	43.750	N
	CHF	5'000.00	04.04.2014	04.10.2019	23 919 316	%	101.950	100.306	04.10.	0.750	37.500	N
	GBP	1'000.00	13.11.2012	13.11.2019	19 985 125	%	101.590	99.363	13.11.	2.125	27.736	N
	CHF	5'000.00	02.10.2012	02.10.2020	19 012 504	%	103.700	100.336	02.10.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	22.03.2011	22.03.2021	12 558 985	%	109.400	100.329	22.03.	2.750	137.50	N
	CHF	5'000.00	27.11.2015	27.11.2023	30 279 011	%	101.100	100.119	27.11.	0.250	12.500	N
	CHF	5'000.00	23.06.2015	23.06.2025	28 441 568	%	103.450	100.389	23.06.	0.550	27.500	N
Nordea Hypotek AB, Stockholm, Schweden												
Emissionsdisagio von 0.263% 18.1.2017 Em.preis: 99.737%	EUR	1'000.00	18.01.2010	18.01.2017	10 898 919		-	99.737	18.01. 18.01.	3.500	37.589 2.816	N
Nordic Investment Bank, Helsinki, Finnland	SEK	100'000.00	08.04.2015	08.04.2022	27 818 589	%	101.850	100.000	08.04.	1.000	111.16	N
	NOK	10'000.00	09.08.2012	09.08.2017	19 181 698		-	101.275	09.08.	2.125	25.752	N
	NZD	1'000.00	30.01.2013	30.01.2018	20 488 455	%	100.050	99.551	30.01. 30.07.	3.500	12.811 12.555	N
	CHF	5'000.00	11.03.2009	11.04.2018	3 263 771	%	100.910	100.965	11.04.	2.500	125.00	N
	NOK	10'000.00	24.05.2013	24.05.2018	21 434 870	%	100.380	101.038	24.05.	2.000	23.299	N
	ZAR	5'000.00	25.09.2014	25.09.2018	25 451 315	%	99.500	99.785	25.09.	7.000	25.434	N
	GBP	1'000.00	26.11.1999	26.11.2019	1 016 449	%	108.630	98.750	26.11.	5.250	68.689	N
Tranche 23	NOK	10'000.00	15.07.2015	15.07.2020	28 881 122	%	101.180	99.698	15.07.	1.375	16.263	N
	ZAR	5'000.00	09.07.1997	09.07.2027	653 343	%	42.000	2.857		0.000	0.000	Y
NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank, Luxemburg												
Emissionsdisagio von 0.569% 5.6.2017 Em.preis: 99.431%	USD	1'000.00	04.06.2007	05.06.2017	3 132 955		-	99.431	05.06. 05.06.	5.375	51.846 5.488	N
Norske tog AS, Oslo, Norwegen												
	CHF	5'000.00	14.02.2011	14.02.2020	12 357 509	%	104.950	101.066	14.02.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	02.05.2013	02.05.2023	21 089 198	%	105.450	100.442	02.05.	1.125	56.250	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
North American Development Bank, San Antonio, USA												
	CHF	5'000.00	30.04.2015	30.04.2025	27 834 676	%	101.300	100.619	30.04.	0.250	12.500	N
Northern Gas Networks Finance Plc, London, Grossbritannien	CHF	5'000.00	26.04.2017	26.10.2027	36 274 827	%	99.300	100.324	26.10.	0.200	5.000	N
	GBP	1'000.00	08.07.2009	08.07.2019	10 301 915	%	107.280	99.122	08.07.	5.875	73.063	N
Norwegian State Railways AS, Oslo, Norwegen												
	CHF	5'000.00	15.11.2010	15.11.2017	11 888 235		-	100.353	15.11.	1.375	68.750	N
Novartis Capital Corp, USA												
	USD	1'000.00	16.03.2010	24.04.2020	11 118 258	%	104.790	99.237	24.04. 24.10.	4.400	21.901 21.775	N
	USD	1'000.00	21.09.2012	21.09.2022	19 607 231	%	99.230	99.225	21.03. 21.09.	2.400	11.921 11.676	N
	USD	1'000.00	21.02.2014	06.05.2024	23 774 411	%	103.970	99.287	06.05. 06.11.	3.400	16.955 17.009	N
Novartis Finance SA, Luxemburg												
	EUR	1'000.00	31.03.2017	31.03.2021	36 213 347	%	99.530	99.133		0.000	0.000	N
	EUR	1'000.00	07.11.2014	09.11.2021	25 971 847	%	102.330	99.134	09.11.	0.750	8.703	N
	EUR	1'000.00	20.09.2016	20.09.2023	33 967 722	%	97.610	99.127	20.09.	0.125	1.442	N
	EUR	1'000.00	07.11.2014	09.11.2026	25 971 511	%	106.880	99.697	09.11.	1.625	18.857	N
	EUR	1'000.00	31.03.2017	30.09.2027	36 213 351	%	101.990	99.874	30.09.	1.125	6.443	N
Novartis Securities Investment Ltd, Hamilton, Bermuda	EUR	1'000.00	20.09.2016	20.09.2028	33 967 723	%	95.720	98.480	20.09.	0.625	7.211	N
	USD	1'000.00	10.02.2009	10.02.2019	2 327 754	%	103.300	99.822	10.02. 10.08.	5.125	25.750 24.700	N
Novo Banco, S.A., Lisboa, Portugal												
25.7.2017 Rückkauf ausstehender Titel	EUR	1'000.00	16.04.2014	16.04.2046	24 293 867	%	20.500	11.474		VAR.	0.000	Y
4.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.03.2014	27.03.2047	24 091 197		-	10.721		0.000	0.000	Y
4.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	13.03.2014	13.03.2048	23 994 268		-	10.021		VAR.	0.000	Y
4.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	22.01.2014	22.01.2049	23 547 635		-	9.366		0.000	0.000	Y
4.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	29.01.2014	29.01.2049	23 620 080		-	9.359		0.000	0.000	Y
4.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung 25.7.2017 Rückkauf ausstehender Titel 4.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	25.03.2014	25.03.2050	24 080 786		-	8.753	04.10.	VAR.	0.000	Y
25.7.2017 Rückkauf ausstehender Titel	EUR	1'000.00	06.03.2014	06.03.2051	23 901 690	%	15.250	8.180		0.000	0.000	Y
NOVOMATIC AG, Gumpoldskirchen, Österreich												
	EUR	500.00	28.01.2013	28.01.2019	20 493 620	%	103.620	101.421	28.01.	4.000	21.378	N
NRW.BANK, Duesseldorf, Deutschland	EUR	500.00	23.06.2014	23.06.2021	24 699 838	%	107.640	99.875	23.06.	3.000	16.275	N
Emissionsdisagio von 0.481% 29.5.2017 Em.preis: 99.519%	EUR	1'000.00	29.05.2007	29.05.2017	3 138 974		-	99.519	29.05. 29.05.	4.500	49.101 5.248	N
NV Bank Nederlandse Gemeenten BNG, Den Haag, Niederlande	NOK	10'000.00	24.05.2013	24.05.2018	21 434 854	%	100.470	101.042	24.05.	2.250	26.211	N
Emissionsdisagio von 0.181% 31.1.2017 Em.preis: 99.819%	USD	1'000.00	31.01.2007	31.01.2017	2 901 550		-	99.819	31.01. 31.01.	5.250	51.795 1.785	N
	NOK	10'000.00	26.03.2012	02.02.2017	14 858 110		-	100.766	02.02.	3.250	39.248	N
	CHF	5'000.00	09.02.2007	09.02.2017	2 864 525		-	100.770	09.02.	2.625	131.25	N
	AUD	2'000.00	16.02.2012	16.02.2017	14 985 468		-	101.469	16.02.	5.625	86.634	N
Emissionsdisagio von 0.416% 28.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung 30.3.2017 Em.preis: 99.584%	EUR	1'000.00	30.03.2010	30.03.2017	11 162 052		-	99.584	 28.03. 30.03.	3.000	 4.446 32.080	N
	SEK	1'000.00	12.04.2012	12.04.2017	18 329 150		-	101.335	12.04.	3.000	3.345	N
	NZD	1'000.00	25.05.2012	25.05.2017	18 582 239		-	101.450	25.05.	4.250	29.105	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	USD	2'000.00	27.09.2012	27.09.2017	19 628 296		-	99.981	27.03. 27.09.	1.375	13.521 13.402	N
Emissionsdisagio von 0.019% 27.9.2017 Em.preis: 99.981%									27.09.		0.37039	
	NOK	10'000.00	30.04.2012	30.10.2017	18 441 319		-	101.541	30.10.	3.500	42.746	N
	CHF	5'000.00	03.11.2010	03.11.2017	11 859 688		-	100.499	03.11.	1.500	75.000	N
	EUR	1'000.00	15.11.2010	15.11.2017	12 002 734		-	99.304		2.500		N
Emissionsdisagio von 0.696%									15.11.		8.128	
15.11.2017 Em.preis: 99.304%									15.11.		29.198	
	GBP	1'000.00	29.11.2010	29.11.2017	12 052 851		-	99.881	29.11.	3.250	42.890	N
29.11.2017 Em.preis: 99.881%												
	ZAR	5'000.00	29.05.1997	29.12.2017	632 712		-	6.750		0.000	0.000	Y
29.12.2017 Em.preis: 6.75%												
	GBP	1'000.00	20.02.2003	20.02.2018	1 557 208	%	100.550	101.260	20.02.	4.500	56.408	N
	AUD	1'000.00	21.02.2014	21.02.2018	23 737 328	%	99.720	99.688	21.02. 21.08.	3.750	14.632 14.180	N
	NZD	1'000.00	23.02.2015	23.02.2018	27 154 382	%	100.250	101.550	23.02.	3.875	28.282	N
	NZD	1'000.00	05.03.2013	05.03.2018	20 776 357	%	100.260	101.275	05.03.	4.125	29.225	N
	CHF	5'000.00	02.07.2007	02.07.2018	3 138 812	%	101.970	100.275	02.07.	3.125	156.25	N
	CHF	5'000.00	06.05.2010	06.11.2018	11 208 695	%	102.440	100.329	06.11.	2.125	106.25	N
	GBP	1'000.00	26.07.2012	07.12.2018	19 096 230	%	101.130	99.634	07.12.	1.875	24.982	N
	NOK	10'000.00	16.05.2013	20.12.2018	21 372 344	%	101.380	101.290	20.12.	2.375	27.893	N
reine Differenzbesteuerung	ZAR	5'000.00	07.04.1998	31.12.2018	868 692	%	92.870	8.150		0.000	0.000	Y
	GBP	10'000.00	18.01.2000	18.01.2019	1 036 121	%	105.300	99.020	18.01.	5.750	710.85	N
	SEK	1'000.00	13.02.2014	13.02.2019	23 645 890	%	102.290	101.525	13.02.	2.125	2.397	N
	NZD	1'000.00	08.08.2014	08.08.2019	25 069 391	%	103.290	101.469	08.08.	4.750	33.960	N
	AUD	1'000.00	17.09.2014	17.09.2019	25 432 114	%	101.890	98.948	17.03. 17.09.	3.500	13.318 13.507	N
	CAD	2'000.00	01.10.2014	01.10.2019	25 503 259	%	100.260	99.826	01.04. 01.10.	2.125	15.873 16.595	N
	CHF	5'000.00	14.10.2009	14.10.2019	10 537 664	%	105.750	100.485	14.10.	2.500	125.00	N
	EUR	1'000.00	02.11.2009	04.11.2019	10 691 716	%	107.640	99.690	04.11.	3.875	44.920	N
	CHF	5'000.00	19.02.2010	19.11.2019	10 941 123	%	105.700	101.019	19.11.	2.375	118.75	N
	AUD	1'000.00	21.11.2013	21.11.2019	22 867 304	%	104.100	101.318	21.11.	4.625	34.788	N
	GBP	1'000.00	18.02.2015	09.12.2019	27 138 651	%	101.140	99.882	09.12.	1.375	18.196	N
	EUR	1'000.00	14.01.2010	14.01.2020	10 896 398	%	108.520	99.362	14.01.	3.750	40.314	N
	NOK	10'000.00	19.03.2015	19.03.2020	27 476 398	%	100.710	101.312	19.03.	1.250	14.716	N
	EUR	1'000.00	01.09.2010	01.09.2020	11 679 766	%	107.580	99.023	01.09.	2.625	30.016	N
	NZD	1'000.00	16.09.2014	16.09.2020	25 424 822	%	105.480	101.515	16.09.	5.000	34.869	N
	CHF	5'000.00	14.10.2005	14.10.2020	2 272 176	%	107.700	101.530	14.10.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	27.10.2010	27.10.2020	11 610 344	%	106.650	100.632	27.10.	1.750	87.500	N
	ZAR	5'000.00	29.05.1997	29.12.2020	632 736	%	79.710	4.825		0.000	0.000	Y
	CHF	5'000.00	23.02.2011	23.02.2021	12 407 195	%	108.500	100.750	23.02.	2.250	112.50	N
	AUD	1'000.00	07.07.2014	07.07.2021	24 794 161	%	104.510	101.561	07.07.	4.125	30.252	N
	NOK	100'000.00	13.06.2017	13.06.2022	37 048 822	%	99.210	99.438		1.250	0.000	N
	EUR	1'000.00	26.08.2015	26.08.2022	29 329 327	%	102.240	99.419	26.08.	0.500	5.709	N
	CHF	5'000.00	13.09.2012	13.09.2022	19 306 983	%	106.650	101.193	13.09.	1.125	56.250	N
	USD	2'000.00	23.01.2013	23.01.2023	20 476 984	%	99.960	99.614	23.01. 23.07.	2.500	24.967 23.650	N
	CHF	5'000.00	19.03.2013	19.04.2023	20 755 001	%	107.700	100.182	19.04.	1.125	56.250	N
	EUR	1'000.00	16.07.2013	17.07.2023	21 867 865	%	111.910	99.849	17.07.	2.250	24.854	N
	CHF	5'000.00	30.04.2014	30.04.2024	24 152 874	%	108.850	100.447	30.04.	1.250	62.500	N
	EUR	1'000.00	07.05.2015	07.05.2025	28 072 885	%	99.100	98.649	07.05.	0.250	2.725	N
	CHF	5'000.00	21.07.2005	21.07.2025	2 189 460	%	119.250	100.830	21.07.	2.500	125.00	N
	CAD	100'000.00	28.07.2010	28.07.2025	11 588 788	%	113.000	100.000	28.07.	4.600	3'586.67	N
	ZAR	5'000.00	31.03.1998	31.12.2025	866 359	%	50.840	3.900		0.000	0.000	Y
	CHF	5'000.00	04.11.2010	04.11.2030	11 884 898	%	119.050	101.566	04.11.	2.000	100.00	N
NV Nederlandse Gasunie, Groningen, Niederlande	CHF	5'000.00	29.06.2007	29.06.2037	3 140 917	%	151.600	100.340	29.06.	3.250	162.50	N
	EUR	1'000.00	31.03.2009	31.03.2017	10 053 624		-	99.289		5.125		N
Emissionsdisagio von 0.711%									29.03.		7.620	
29.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung 31.3.2017 Em.preis: 99.289%									31.03.		54.865	
	EUR	1'000.00	20.06.2006	20.06.2021	2 593 048	%	115.060	99.540	20.06.	4.500	48.863	N
	EUR	1'000.00	13.10.2011	13.10.2021	14 049 850	%	113.310	99.860	13.10.	3.625	41.807	N
	EUR	1'000.00	13.07.2012	13.07.2022	19 000 285	%	109.960	99.480	13.07.	2.625	28.968	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	 %	 Brutto brut lordo CHF		IUP
Nykredit Realkredit A/S, Copenhagen, Dänemark													
	DKK	0.010	01.01.2011	01.01.2017	13 680 408		-	100.000	01.01.	2.000	0.00002		N
	DKK	0.010	14.01.2003	01.07.2020	1 541 124	%	102.850	100.000	01.01.	4.000	0.00001		N
									01.04.		0.00001		
									01.07.		0.00001		
									01.10.		0.00001		
	DKK	0.010	07.01.1998	01.10.2029	837 225	%	110.020	89.450	01.01.	5.000	0.00001		N
									01.04.		0.00001		
									01.07.		0.00001		
									01.10.		0.00001		

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Oberoesterreichische Landesbank AG, Linz, Österreich												
	CHF	5'000.00	20.12.2006	20.06.2017	2 788 645		-	100.550	20.06.	2.500	125.00	N
OEBB-Infrastruktur AG, Wien, Österreich												
	EUR	1'000.00	02.07.2009	02.07.2019	10 295 579	%	107.420	99.220	02.07.	4.500	49.268	N
	EUR	1'000.00	19.10.2005	19.10.2020	2 307 480	%	109.740	99.415	19.10.	3.500	40.425	N
	EUR	1'000.00	13.07.2011	13.07.2021	13 336 133	%	113.260	99.860	13.07.	3.625	40.003	N
	EUR	1'000.00	04.07.2013	04.07.2023	21 765 238	%	110.920	99.593	04.07.	2.250	24.647	N
	EUR	1'000.00	30.06.2010	30.06.2025	11 461 125	%	124.790	99.352	30.06.	3.875	42.324	N
	EUR	1'000.00	17.10.2011	19.10.2026	14 070 096	%	124.040	99.426	19.10.	3.500	40.425	N
Oesterreichische Kontrollbank AG OEKB, Wien, Österreich												
	CHF	5'000.00	14.06.2011	14.06.2017	13 042 053		-	100.618	14.06.	1.750	87.500	N
	CHF	5'000.00	24.05.2012	24.05.2018	18 191 574	%	100.770	100.608	24.05.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	18.10.2005	18.10.2018	2 278 864	%	102.280	101.120	18.10.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	23.02.2011	23.07.2019	12 429 576	%	104.450	100.978	23.07.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	28.01.2005	28.01.2020	2 037 240	%	106.950	101.190	28.01.	2.750	137.50	N
	CHF	5'000.00	26.07.2013	24.07.2020	21 737 428	%	104.300	100.522	24.07.	1.125	56.250	N
	CHF	5'000.00	28.09.2012	28.09.2021	19 012 505	%	105.150	100.425	28.09.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	14.06.2007	14.06.2022	3 110 206	%	114.700	100.050	14.06.	3.000	150.00	N
	CHF	5'000.00	24.05.2012	24.05.2023	18 191 573	%	110.550	100.522	24.05.	1.750	87.500	N
	CHF	5'000.00	22.11.2006	22.11.2024	2 775 220	%	118.600	101.210	22.11.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	25.02.2005	25.02.2030	2 063 214	%	130.800	100.550	25.02.	2.875	143.75	N
	CHF	5'000.00	25.07.2006	25.07.2036	2 621 345	%	148.800	102.050	25.07.	3.250	162.50	N
OMV AG, Wien, Österreich												
Perpetual Fixed to Reset Rate Notes 2015-Without Fixed Maturity Variable Rate Reg-S	EUR	1'000.00	07.12.2015		30 634 532	%	126.100	99.999	09.12.	6.250	73.028	N
Perpetual Fixed to Reset Rate Notes 2015-Without Fixed Maturity Variable Rate Reg-S	EUR	1'000.00	07.12.2015		30 634 254	%	114.180	99.999	09.12.	5.250	61.343	N
	EUR	1'000.00	10.02.2010	10.02.2020	10 996 710	%	109.110	99.437	10.02.	4.375	46.833	N
Ooredoo International Finance Ltd, Hamilton, Bermuda												
	USD	1'000.00	10.06.2009	10.06.2019	10 249 794	%	107.430	98.894	12.06. 10.12.	7.875	38.160 38.571	N
	USD	1'000.00	14.10.2010	16.02.2021	11 861 454	%	105.110	99.161	16.02. 16.08.	4.750	23.717 23.162	N
	USD	1'000.00	19.12.2012	21.02.2023	20 260 965	%	98.870	98.721	21.02. 21.08.	3.250	16.405 15.605	N
	USD	1'000.00	19.10.2010	19.10.2025	11 887 380	%	107.850	98.960	19.04. 19.10.	5.000	24.951 24.359	N
	USD	1'000.00	31.01.2013	31.01.2028	20 549 523	%	99.330	98.834	31.01. 31.07.	3.875	19.115 18.694	N
	USD	1'000.00	31.01.2013	31.01.2043	20 550 027	%	102.060	97.697	31.01. 31.07.	4.500	22.198 21.709	N
OP Corporate Bank PLC, Helsinki, Finnland												
	CHF	5'000.00	14.07.2014	14.07.2021	24 716 361	%	103.900	101.088	14.07.	1.000	50.000	N
OP-Asuntoluottopankki Oyj, Helsinki, Finnland												
Emissionsdisagio von 0.309% 23.5.2017 Em.preis: 99.691%	EUR	1'000.00	23.05.2012	23.05.2017	18 634 783		-	99.691	23.05. 23.05.	1.625	17.729 3.371	N
Optus Finance Pty Ltd, Macquarie Park, Australien	EUR	1'000.00	11.07.2011	11.07.2018	13 304 733	%	101.670	99.439	11.07.	3.500	38.704	N
	AUD	10'000.00	17.06.2015	17.06.2022	28 531 781	%	102.085	98.783	17.06. 17.12.	4.000	147.65 151.69	N
Oracle Corporation, Redwood City, USA												
Emissionsdisagio von 0.173% 15.10.2017 Em.preis: 99.827%	USD	1'000.00	25.10.2012	15.10.2017	19 871 686		-	99.827	15.04. 15.10. 15.10.	1.200	6.009 5.850 1.687	N
	USD	1'000.00	16.07.2013	15.01.2019	21 869 044	%	100.280	99.652	15.01. 15.07.	2.375	12.005 11.435	N
	USD	1'000.00	25.10.2012	15.10.2022	19 871 694	%	99.660	99.878	15.04. 15.10.	2.500	12.520 12.189	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Orange, Paris, Frankreich												
	EUR	1'000.00	21.02.2007	21.02.2017	2 921 719		-	99.828	21.02.	4.750	50.666	N
Emissionsdisagio von 0.172%									21.02.		1.829	
21.2.2017 Em.preis: 99.828%												
	GBP	1'000.00	20.12.2002	20.12.2017	1 532 355		-	99.575	20.12.	8.000	105.60	N
20.12.2017 Em.preis: 99.575%									20.12.		5.610	
	EUR	1'000.00	22.05.2008	22.05.2018	4 243 505	%	102.190	99.500	22.05.	5.625	61.545	N
	USD	1'000.00	06.02.2014	06.02.2019	23 606 674	%	100.560	99.916	06.02.	2.750	13.649	N
									06.08.		13.370	
	USD	1'000.00	07.07.2009	08.07.2019	10 319 843	%	104.390	99.488	08.01.	5.375	27.320	N
									08.07.		25.982	
	EUR	100'000.00	02.04.2013	02.10.2019	21 043 510	%	103.380	99.472	02.10.	1.875	2'142.09	N
	EUR	1'000.00	09.04.2010	09.04.2020	11 190 060	%	108.640	99.172	09.04.	3.875	41.402	N
	EUR	50'000.00	29.11.2010	14.01.2021	12 058 653	%	111.170	99.835	14.01.	3.875	2'082.97	N
	USD	1'000.00	14.09.2011	14.09.2021	13 818 595	%	105.670	98.990	14.03.	4.125	20.784	N
									14.09.		19.942	
	EUR	100'000.00	14.09.2012	01.03.2023	19 440 576	%	110.170	99.120	01.03.	2.500	2'662.50	N
	GBP	1'000.00	05.12.2005	05.12.2025	2 351 025	%	122.070	99.003	05.12.	5.250	69.753	N
	GBP	1'000.00	20.11.2008	20.11.2028	4 823 122	%	153.720	98.454	20.11.	8.125	106.79	N
Oresundsbron IS, Kobenhavn, Dänemark												
	SEK	1'000'000.00	22.08.2006	01.12.2020	2 821 102	%	114.290	100.000	01.12.	5.000	5'877.80	N
Orsted, Fredericia, Dänemark												
	EUR	1'000.00	19.09.2012	19.09.2022	19 491 031	%	110.360	99.324	19.09.	2.625	30.274	N
16.11.2017 Rückkauf ausstehender Titel												
Otto (GmbH & Co KG), Hamburg, Deutschland												
	EUR	1'000.00	01.11.2012	01.11.2019	19 893 770	%	105.240	99.250	01.11.	3.875	45.074	N
	EUR	1'000.00	17.09.2013	17.09.2020	22 340 589	%	107.340	99.246	17.09.	3.750	43.048	N
	EUR	1'000.00	12.06.2017	12.06.2024	37 026 409	%	99.420	99.514		1.875	0.000	N
O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH, Muenchen, Deutschland												
	EUR	1'000.00	10.02.2014	10.02.2021	23 628 146	%	106.660	99.624	10.02.	2.375	25.423	N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Paccar Financial Europe BV, Eindhoven, Niederlande												
	CHF	5'000.00	06.03.2012	06.03.2017	14 942 878		-	100.403	06.03.	1.125	56.250	N
Partner Re Finance LLC, Greenwich, USA												
	USD	1'000.00	15.03.2010	01.06.2020	11 127 116	%	106.650	99.885	01.06. 01.12.	5.500	26.659 27.064	N
PCC SE, Duisburg, Deutschland												
	EUR	1'000.00	01.02.2013	01.10.2017	20 737 815		-	100.000	01.01. 01.04. 01.07. 01.10.	7.250	19.523 19.100 19.789 20.877	N
	EUR	1'000.00	01.07.2013	01.04.2018	21 773 468	%	101.020	100.000	01.01. 01.04. 01.07. 01.10.	7.000	18.850 18.442 19.107 20.157	N
	EUR	1'000.00	01.05.2015	01.04.2020	28 142 958	%	101.000	100.000	01.01. 01.04. 01.07. 01.10.	6.000	16.158 15.807 16.377 17.277	N
	EUR	1'000.00	01.12.2014	01.10.2021	26 334 671	%	108.500	100.000	01.01. 01.04. 01.07. 01.10.	6.750	18.177 17.783 18.424 19.437	N
PepsiCo Inc., New York, USA												
	USD	1'000.00	26.10.2010	01.11.2020	11 915 779	%	102.230	99.167	01.05. 01.11.	3.125	15.530 15.645	N
Pernod Ricard, Paris, Frankreich												
Emissionsdisagio von 0.405% 15.3.2017 Em.preis: 99.595%	EUR	100'000.00	15.03.2011	15.03.2017	12 659 547		-	99.595	15.03. 15.03.	5.000	5'358.25 434.01	N
Petrobras Global Finance B.V., Rotterdam, Niederlande												
Emissionsdisagio von 0.581% 6.2.2017 Em.preis: 99.419%	USD	1'000.00	06.02.2012	06.02.2017	14 916 000		-	99.419	06.02. 06.02.	3.500	17.372 5.767	N
Emissionsdisagio von 0.295% Rückzahlungsagio von 1.8% 22.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	14.01.2014	15.01.2018	23 299 057		-	99.705	16.01. 22.06. 22.06. 22.06.	2.750	29.564 12.912 3.200 19.525	N
Emissionsdisagio von 0.979% Rückzahlungsagio von 3.568% 22.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	09.12.2011	07.03.2018	14 466 782		-	99.021	07.03. 22.06. 22.06. 22.06.	4.875	52.274 15.501 10.619 38.703	N
	USD	1'000.00	20.05.2013	15.01.2019	21 412 784	%	99.700	99.352	15.01. 15.07.	3.000	15.164 14.444	N
	EUR	1'000.00	01.10.2012	01.04.2019	19 655 139	%	103.510	99.398	01.04.	3.250	34.726	N
	USD	1'000.00	17.03.2014	17.03.2020	23 929 931	%	102.450	99.743	17.03. 17.09.	4.875	24.325 23.406	N
	USD	1'000.00	27.01.2011	27.01.2021	12 381 296	%	104.040	99.801	27.01. 27.07. 18.09.	5.375	26.824 25.885 60.016	N
	EUR	1'000.00	09.12.2011	07.03.2022	14 467 033	%	115.880	99.266	07.03.	5.875	62.997	N
	EUR	1'000.00	01.10.2012	02.10.2023	19 650 394	%	109.300	98.154	02.10.	4.250	48.554	N
	USD	1'000.00	17.03.2014	17.03.2024	23 929 934	%	105.350	99.772	17.03. 17.09.	6.250	31.185 30.008	N
	USD	1'000.00	27.01.2011	27.01.2041	12 384 726	%	99.800	99.288	27.01. 27.07.	6.750	33.686 32.507	N
Petroleos De Venezuela SA PDVSA, Caracas, Venezuela												
	USD	100.00	12.04.2007	12.04.2017	3 028 894		-	105.500	12.04.	5.250	2.637	N
Petroleos Mexicanos PEMEX, Ciudad De México, Mexiko	USD	1.00	17.05.2012	17.05.2035	18 971 074	%	26.450	95.000	17.05. 17.11.	9.750	0.04772 0.0483	N
Emissionsdisagio von 0.689% 9.1.2017 Em.preis: 99.311%	EUR	1'000.00	08.10.2009	09.01.2017	10 629 355		-	99.311	09.01. 09.01.	5.500	59.179 7.393	N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	AUD	2'000.00	26.04.2012	26.04.2017	18 441 614		-	101.340	26.04.	6.125	91.052	N
	CHF	5'000.00	14.06.2016	14.06.2018	32 373 565	%	100.660	100.211	14.06.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	10.04.2012	10.04.2019	18 164 688	%	102.750	100.823	10.04.	2.500	125.00	N
	CHF	5'000.00	08.12.2015	08.12.2020	30 511 788	%	102.850	100.168	08.12.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	14.06.2016	14.12.2021	32 373 566	%	106.450	100.550	14.12.	2.375	118.75	N
	EUR	1'000.00	21.04.2015	21.04.2022	27 912 366	%	102.630	99.320	21.04.	1.875	20.014	N
	GBP	1'000.00	02.06.2009	02.06.2022	10 218 028	%	124.000	99.406	02.06.	8.250	102.43	N
	USD	1'000.00	21.09.2016	21.09.2023	33 961 077	%	90.860	100.000	21.03. 21.09.	4.625	22.974 22.501	N
	EUR	1'000.00	24.02.2005	24.02.2025	2 073 853	%	118.310	99.086	24.02.	5.500	58.677	N
Peugeot S.A., Paris, Frankreich												
	EUR	1'000.00	06.03.2013	06.03.2018	20 839 915	%	100.870	99.494	06.03.	7.375	79.041	N
	EUR	1'000.00	15.04.2016	14.04.2023	32 228 715	%	105.330	100.000	14.04.	2.375	25.298	N
Pfandbriefbank (Oesterreich) AG, Wien, Österreich												
	CHF	5'000.00	21.07.2003	21.07.2017	1 625 364		-	100.590	21.07.	2.875	143.75	N
Pfizer Inc., New York, USA												
Emissionsdisagio von 0.207% 1.4.2017 Em.preis: 99.793%	USD	1'000.00	27.03.2007	01.04.2017	3 020 109		-	99.793	01.04. 01.04.	5.450	27.333 2.076	N
15.5.2017 Em.preis: 99.912% Emissionsdisagio von 0.088%	USD	1'000.00	15.05.2014	15.05.2017	24 451 976		-	99.912	15.05. 15.05.	1.100	5.500 0.87703	N
	USD	1'000.00	09.12.1998	01.12.2018	1 151 656	%	103.730	99.582	01.06. 01.12.	6.500	31.506 31.985	N
8.12.2017 Rückkauf ausstehender Titel	EUR	50'000.00	03.06.2009	03.06.2021	10 234 548	%	119.710	99.525	03.06.	5.750	3'120.52	N
Philip Morris International Inc., New York, USA												
Emissionsdisagio von 1.075% 21.8.2017 Em.preis: 98.925%	USD	1'000.00	21.08.2012	21.08.2017	19 289 110		-	98.925	21.02. 21.08. 21.08.	1.125	5.678 5.401 10.323	N
	USD	1'000.00	25.02.2016	25.02.2019	31 659 753	%	99.140	99.643	25.02. 25.08.	1.375	6.913 6.588	N
	CHF	5'000.00	11.03.2013	11.03.2019	20 690 376	%	101.570	100.259	11.03.	0.875	43.750	N
	EUR	1'000.00	30.05.2012	30.05.2019	18 666 649	%	102.230	99.493	30.05.	2.125	23.165	N
	CHF	5'000.00	16.05.2014	16.12.2019	24 306 935	%	102.200	100.744	16.12.	0.750	37.500	N
	EUR	1'000.00	19.03.2013	19.03.2020	20 968 232	%	103.540	99.356	19.03.	1.750	18.755	N
	CHF	5'000.00	18.09.2012	18.09.2020	19 329 699	%	103.500	100.534	18.09.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	06.12.2011	06.12.2021	13 659 438	%	108.000	100.853	06.12.	2.000	100.00	N
	USD	1'000.00	21.08.2012	22.08.2022	19 289 113	%	98.780	98.872	22.02. 22.08.	2.500	12.647 12.098	N
	CHF	5'000.00	16.05.2014	16.05.2024	24 306 936	%	109.250	101.071	16.05.	1.625	81.250	N
	EUR	1'000.00	30.05.2012	30.05.2024	18 665 177	%	111.910	98.805	30.05.	2.875	31.341	N
Phoenix Natural Gas Finance PLC, Belfast, Grossbritannien	EUR	1'000.00	03.06.2013	03.06.2033	21 532 451	%	119.260	98.211	03.06.	3.125	33.918	N
Emissionsdisagio von 0.627% 10.7.2017 Em.preis: 99.373%	GBP	1'000.00	03.11.2009	10.07.2017	10 699 632		-	99.373	10.01. 10.07. 10.07.	5.500	34.235 33.918 7.797	N
PHOENIX PIB Dutch Finance B.V., Maarssen, Niederlande												
	EUR	1'000.00	27.05.2013	27.05.2020	21 443 104	%	105.910	99.229	27.05.	3.125	34.098	N
PKO Bank Polski S.A., Warszawa, Polen												
	CHF	5'000.00	02.11.2017	02.11.2021	38 599 707	%	100.550	100.149		0.300	0.000	N
PORR AG, Wien, Österreich												
	EUR	500.00	28.10.2014	28.10.2019	25 643 455	%	104.600	100.000	28.10.	3.875	22.460	N
Portugiesische Republik, Portugal												
16.10.2017 Em.preis: 99.907% Emissionsdisagio von 0.093%	EUR	0.010	03.05.2007	16.10.2017	3 077 464		-	99.907	16.10. 16.10.	4.350	0.0005 0.00001	N
	EUR	0.010	04.03.2008	15.06.2018	3 826 211	%	101.990	99.987	15.06.	4.450	0.00048	N
	EUR	0.010	17.02.2010	15.06.2020	11 024 255	%	111.590	99.841	15.06.	4.800	0.00052	N
	EUR	0.010	23.02.2005	15.04.2021	2 072 200	%	111.750	99.847	15.04.	3.850	0.0004	N
	EUR	0.010	10.06.2008	25.10.2023	4 291 399	%	122.980	99.624	25.10.	4.950	0.00057	N
	EUR	0.010	20.01.2015	15.10.2025	26 701 331	%	110.200	99.598	15.10.	2.875	0.00033	N
	EUR	0.010	22.03.2006	15.04.2037	2 489 017	%	118.590	99.596	15.04.	4.100	0.00043	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Premier Foods Finance PLC, London, Grossbritannien												
	GBP	1'000.00	17.03.2014	15.03.2021	23 901 807	%	102.300	100.000	15.03. 15.09.	6.500	40.044 42.426	N
Principal Financial Global Funding II LLC, Kaimaninseln												
Emissionsdisagio von 0.355% 26.1.2017 Em.preis: 99.645%	EUR	50'000.00	26.01.2007	26.01.2017	2 888 628		-	99.645	26.01. 26.01.	4.500	2'408.79 189.50	N
Procter & Gamble Company (The), Cincinnati, USA												
Emissionsdisagio von 0.771% 24.10.2017 Em.preis: 99.229%	EUR	1'000.00	24.10.2007	24.10.2017	3 495 022		-	99.229	24.10. 24.10.	5.125	59.660 8.975	N
	EUR	1'000.00	07.12.2005	07.12.2020	2 358 100	%	112.120	99.835	07.12.	4.125	48.295	N
	EUR	1'000.00	05.11.2013	05.11.2021	22 742 836	%	107.270	99.452	05.11.	2.000	23.185	N
	USD	1'000.00	06.02.2012	06.02.2022	14 916 004	%	99.410	99.292	06.02. 06.08.	2.300	11.415 11.182	N
	EUR	1'000.00	16.08.2012	16.08.2022	19 258 271	%	107.670	99.160	16.08.	2.000	22.829	N
	EUR	1'000.00	11.05.2007	11.05.2027	3 091 908	%	134.960	99.012	11.05.	4.875	53.349	N
	GBP	1'000.00	31.01.2000	31.01.2030	1 036 247	%	145.140	99.935	31.01.	6.250	77.575	N
Programa Cedulas Tda, Fondo de Titulizacion de Activos, Madrid, Spanien	USD	1'000.00	27.01.2004	01.02.2034	1 777 065	%	128.270	99.577	01.02. 01.08.	5.500	27.289 26.555	N
	EUR	100'000.00	10.04.2006	10.04.2021	2 520 010	%	113.370	97.772	10.04.	4.125	4'407.35	N
PROKON Regenerative Energien eG, Itzehoe, Deutschland	EUR	100'000.00	10.04.2006	10.04.2031	2 520 012	%	128.850	96.409	10.04.	4.250	4'540.91	N
	EUR	9.28	08.06.2016	25.06.2030	32 618 364	%	79.600	100.000	26.06.	3.500	0.2486	N
ProSiebenSat.1 Media SE, Unterföhring, Deutschland												
	EUR	1'000.00	15.04.2014	15.04.2021	24 214 080	%	102.720	99.414	15.04.	2.625	28.038	N
Province of Alberta, Edmonton, Kanada												
15.12.2017 Em.preis: 99.605%	CAD	1'000.00	21.11.2012	15.12.2017	20 053 649		-	99.605	15.06. 15.12. 15.12.	1.700	6.213 6.591 3.054	N
Province Of Mendoza, Mendoza, Argentinien												
	USD	1'000.00	19.05.2016	19.05.2024	32 598 788	%	110.800	98.710	19.05. 19.11.	8.375	40.807 41.500	N
Province of New Brunswick, Fredericton, Kanada												
	CHF	5'000.00	19.01.2017	19.01.2029	34 755 687	%	99.250	100.474		0.250	0.000	N
Province of Ontario, Toronto, Kanada	CHF	5'000.00	07.11.2016	07.11.2031	34 336 680	%	96.850	100.444	07.11.	0.200	10.000	N
Emissionsdisagio von 0.256% 8.9.2017 Em.preis: 99.744%	CAD	1'000.00	08.09.2011	08.09.2017	14 822 615		-	99.744	08.03. 08.09. 08.09.	1.900	7.100 7.470 1.996	N
	CHF	5'000.00	30.07.2008	30.07.2018	4 359 520	%	102.610	100.800	30.07.	3.750	187.50	N
	EUR	1'000.00	23.04.2009	23.04.2019	10 123 361	%	106.010	99.176	23.04.	4.750	51.364	N
	CHF	5'000.00	29.04.2009	29.04.2019	10 103 253	%	105.650	100.826	02.05.	3.375	168.75	N
	EUR	1'000.00	03.12.2009	03.12.2019	10 778 370	%	108.320	99.960	03.12.	4.000	46.678	N
	CHF	5'000.00	04.12.2009	04.12.2019	10 721 296	%	105.950	100.394	04.12.	2.500	125.00	N
	CHF	5'000.00	07.05.2010	07.05.2020	11 213 879	%	106.700	101.009	07.05.	2.375	118.75	N
Province of Quebec, Quebec City, Kanada	CHF	5'000.00	28.06.2017	28.06.2029	36 720 675	%	99.250	100.266		0.250	0.000	N
	CHF	5'000.00	21.12.2006	21.06.2017	2 798 451		-	101.020	21.06.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	19.05.2008	19.01.2018	3 962 172	%	100.180	100.101	19.01.	3.375	168.75	N
	EUR	1'000.00	29.04.2008	29.04.2018	3 982 481	%	101.740	99.922	29.04.	4.750	51.544	N
	USD	1'000.00	14.05.2008	14.05.2018	4 232 000	%	97.600	99.399	14.05. 14.11.	4.625	23.047 22.934	N
	CHF	5'000.00	11.02.2009	11.12.2018	4 948 461	%	104.350	100.965	11.12.	3.875	193.75	N
	EUR	1'000.00	29.04.2009	29.04.2019	10 134 367	%	107.010	99.615	29.04.	5.000	54.257	N
	CAD	1'000.00	08.05.2009	01.12.2019	10 172 418	%	104.930	100.390	01.06. 01.12.	4.500	16.132 17.438	N
	CHF	5'000.00	17.12.2009	17.12.2021	10 755 939	%	112.450	101.324	17.12.	2.875	143.75	N
	CHF	5'000.00	22.02.2013	22.02.2023	20 583 261	%	106.500	100.726	22.02.	1.125	56.250	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	CHF	5'000.00	05.02.2014	05.02.2024	23 284 234	%	109.500	100.176	05.02.	1.500	75.000	N
	CHF	5'000.00	21.11.2014	21.11.2024	25 840 445	%	105.150	100.462	21.11.	0.750	37.500	N
	CAD	1'000.00	17.08.2011	01.12.2043	13 649 847	%	124.870	103.875	01.06. 01.12.	4.250	15.235 16.469	N
Provincia de Buenos Aires, Cuidad de La Plata, Argentinien												
	EUR	1.00	12.01.2006	15.05.2035	2 328 190	%	85.800	45.500	15.05. 15.11.	VAR.	0.02188 0.02335	N
Prudential Financial, Inc., Newark, USA												
	USD	1'000.00	19.11.2012	15.06.2043	20 043 843	%	108.280	99.994	15.06. 15.12.	5.625	27.417 27.895	N
Prudential plc, London, Grossbritannien												
6 1/2 % Notes 2003-Without Fixed Maturity Reg-S Subord.	USD	1'000.00	23.06.2003		1 620 732		-	100.000	23.03. 23.06. 23.09. 23.12.	6.500	16.127 15.742 15.747 16.080	N
23.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
PSB Finance SA, Luxemburg												
	USD	1'000.00	06.11.2012	06.11.2019	19 943 864	%	96.000	100.000	06.05. 06.11.	10.200	50.866 51.028	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
QBE Insurance Group Limited, Subiaco, Australien												
	USD	1'000.00	01.05.2013	01.05.2018	21 268 039		-	99.817	01.05. 01.11. 29.12.	2.400	11.927 12.016 3.767	N
Emissionsdisagio von 0.183% Rückzahlungsagio von 0.252%									29.12. 29.12.		1.783 2.455	
QNB FINANCE LTD, Kaimaninseln												
	USD	1'000.00	14.11.2012	14.02.2018	19 997 642	%	99.800	99.293	14.02. 14.08.	2.125	10.710 10.307	N
Qualcomm Incorporated, San Diego, USA												
	USD	1'000.00	20.05.2015	20.05.2025	28 266 943	%	98.970	99.640	20.05. 20.11.	3.450	16.779 17.095	N
Queensland Treasury Corporation, Brisbane, Australien												
	AUD	1'000.00	08.08.2012	21.06.2019	19 191 082	%	102.900	98.666	21.06. 21.12.	4.000	14.681 15.264	N
	CHF	5'000.00	16.09.2011	16.09.2039	13 457 725	%	119.750	101.566	16.09.	1.720	86.000	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Rabobank Capital Funding Trust IV, Newark, USA												
Regd.Noncumulative Guaranteed Trust Preferred Securities 2004-Without Fixed Maturity Variable Rate Reg-S Senior	GBP	1'000.00	21.10.2004		1 977 816	%	106.850	100.000	31.12.	5.556	73.242	N
Rabobank Nederland, Australia Branch, Sydney, Australien												
	NZD	1'000.00	16.11.2012	16.11.2017	19 985 139		-	101.220	16.11.	4.125	28.093	N
	AUD	1'000.00	22.01.2013	22.01.2018	20 423 369	%	100.020	101.160	23.01.	4.250	32.261	N
	AUD	1'000.00	19.06.2013	19.09.2018	21 579 221	%	101.010	101.043	19.09.	4.125	31.775	N
	NZD	1'000.00	28.02.2013	28.02.2019	20 785 623	%	102.360	101.130	28.02.	4.625	33.499	N
	AUD	2'000.00	05.04.2013	05.04.2019	21 014 206	%	102.590	101.283	05.04.	4.625	70.390	N
	AUD	10'000.00	11.02.2015	11.02.2020	27 038 293	%	100.890	99.293	11.02. 11.08.	3.250	125.82 122.17	N
	AUD	2'000.00	29.05.2015	29.06.2020	28 318 594	%	101.930	101.237	29.06.	3.375	49.597	N
	AUD	2'000.00	27.01.2015	21.08.2020	26 733 257	%	101.650	101.078	21.08.	3.250	49.567	N
	AUD	1'000.00	03.02.2016	03.03.2021	31 311 268	%	102.000	101.104	03.03.	3.375	27.851	N
	AUD	1'000.00	23.05.2016	23.08.2021	32 601 886	%	100.790	100.967	23.08.	3.000	22.858	N
	AUD	1'000.00	02.12.2014	13.01.2022	26 162 260	%	104.820	101.253	13.01.	4.250	32.239	N
Raiffeisen Bank International AG, Wien, Österreich												
	EUR	1'000.00	23.10.2013	23.10.2020	22 507 907	%	103.330	100.000	23.01. 24.04. 24.07. 23.10.	VAR.	5.430 5.471 5.573 5.858	N
	CHF	5'000.00	24.10.2012	24.10.2022	19 440 534	%	118.150	100.389	24.10.	4.750	237.50	N
	EUR	1'000.00	29.10.2012	27.04.2023	19 802 877	%	102.000	100.000	27.04.	5.875	63.499	N
	CHF	5'000.00	24.05.2013	24.05.2023	21 293 721	%	101.850	101.000	24.05.	4.000	200.00	N
Raiffeisenlandesbank Niederoesterreich-Wien AG, Wien, Österreich												
	CHF	5'000.00	12.11.2012	12.11.2020	19 810 457	%	104.250	100.635	12.11.	1.000	50.000	N
5 7/8 % Notes 2013-27.11.23 Series 46 Subord.	EUR	100'000.00	27.11.2013	27.11.2023	22 918 695	%	114.830	99.815	27.11.	5.875	6'868.46	N
Raiffeisenlandesbank Oberoesterreich AG, Linz, Österreich												
	EUR	1'000.00	03.04.2012	03.04.2017	18 292 556		-	101.000	03.01. 03.04.	VAR.	6.677 6.678	N
	CHF	5'000.00	13.11.2012	13.11.2018	19 893 773	%	99.800	100.070	13.02. 15.05. 14.08. 13.11.	VAR.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Raiffeisenlandesbank Vorarlberg Waren- und Revisionsverband reg.GEn.m.b.H., Bregenz, Österreich												
	EUR	500.00	21.02.2014	21.02.2017	23 431 012		-	100.000	21.02.	2.000	10.637	N
RAKFUNDING CAYMAN LTD, Kaimaninseln												
	USD	1'000.00	24.06.2014	24.06.2019	24 739 621	%	100.800	99.275	24.06. 24.12.	3.250	15.769 16.080	N
Rallye SA, Paris, Frankreich												
	EUR	100'000.00	15.10.2012	15.10.2018	19 713 369	%	102.690	100.000	15.10.	5.000	5'752.25	N
	EUR	100'000.00	11.03.2013	11.03.2019	20 863 967	%	102.840	100.000	11.03.	4.250	4'565.35	N
	CHF	5'000.00	23.11.2016	23.11.2020	34 144 032	%	103.900	100.000	23.11.	4.000	200.00	N
Ralph Lauren Corporation, New York, USA												
	USD	1'000.00	18.08.2015	18.08.2020	29 275 113	%	100.380	99.795	18.02. 18.08.	2.625	13.153 12.622	N
RCI Banque SA, Noisy le Grand, Frankreich												
Emissionsdisagio von 0.559% 27.4.2017 Em.preis: 99.441%	EUR	1'000.00	27.04.2012	27.04.2017	18 440 812		-	99.441	27.04. 27.04.	4.250	45.936 6.041	N
	EUR	1'000.00	22.03.2013	22.01.2018	20 936 583	%	100.050	99.765	22.01.	2.875	30.940	N
	USD	1'000.00	03.04.2013	03.04.2018	21 034 552	%	100.320	99.845	03.04. 03.10.	3.500	17.553 17.042	N
	EUR	1'000.00	30.09.2014	30.09.2019	25 484 954	%	102.040	99.836	02.10.	1.125	12.922	N
	EUR	1'000.00	04.03.2015	04.03.2020	27 309 029	%	100.910	99.833	04.03.	0.625	6.698	N
	EUR	1'000.00	17.11.2015	17.11.2020	30 367 665	%	103.390	99.779	17.11.	1.375	16.053	N
Tranche 1 Reg S	CHF	5'000.00	20.04.2017	20.04.2022	36 225 799	%	101.300	100.074		0.500	0.000	N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	EUR	1'000.00	08.06.2015	08.06.2022	28 403 897	%	102.830	99.356	08.06.	1.250	13.566	N
Realkredit Danmark A/S, Kobenhavn, Dänemark												
	DKK	0.010	19.01.2005	01.01.2038	2 045 894	%	113.150	100.000	01.01. 01.04. 01.07. 01.10.	5.000	0.00001 0.00001 0.00001 0.00001	N
Red Electrica Financiaciones Sociedad Anonima Unipersonal, Alcobendas, Spanien												
	EUR	100'000.00	18.02.2011	16.02.2018	12 461 124	%	100.520	99.861	16.02.	4.750	5'075.70	N
	EUR	100'000.00	31.05.2013	31.05.2019	21 442 716	%	103.400	99.509	31.05.	2.375	2'584.00	N
	EUR	100'000.00	29.04.2011	29.04.2020	12 886 008	%	111.250	99.814	29.04.	4.875	5'290.10	N
	EUR	100'000.00	25.01.2013	25.01.2022	20 456 049	%	114.490	99.858	25.01.	3.875	4'170.23	N
Reed Elsevier (Investments) PLC, London, Grossbritannien												
	GBP	50'000.00	31.03.2009	11.12.2017	10 050 988		-	98.755	11.12. 11.12.	7.000	4'631.71 823.78	N
Emissionsdisagio von 1.245% 11.12.2017 Em.preis: 98.755%												
Régie Autonome des Transports Parisiens SA RATP, Paris, Frankreich												
	CHF	5'000.00	09.10.2007	09.10.2017	3 390 241		-	100.969	09.10.	3.250	162.50	N
	CHF	5'000.00	06.11.2008	06.11.2017	4 635 460		-	101.263	06.11.	3.250	162.50	N
	CHF	5'000.00	06.11.2006	06.11.2019	2 733 324	%	105.800	100.710	06.11.	2.625	131.25	N
Region Ile de France, Paris, Frankreich												
	EUR	50'000.00	25.07.2006	25.07.2017	2 628 584		-	99.174	25.07. 25.07.	4.250	2'351.31 456.98	N
Emissionsdisagio von 0.826% 25.7.2017 Em.preis: 99.174%												
	CHF	5'000.00	08.07.2010	08.12.2017	11 226 300		-	101.194	08.12.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	27.11.2007	27.11.2018	3 503 134	%	103.670	101.322	27.11.	3.250	162.50	N
Renault SA, Boulogne-Billancourt, Frankreich												
	EUR	1'000.00	22.03.2010	22.03.2017	11 127 599		-	99.386	22.03. 22.03.	5.625	60.139 6.564	N
Emissionsdisagio von 0.614% 22.3.2017 Em.preis: 99.386%												
	EUR	1'000.00	18.09.2012	18.09.2017	19 495 212		-	99.891	18.09. 18.09.	4.625	53.092 1.251	N
Emissionsdisagio von 0.109% 18.9.2017 Em.preis: 99.891%												
Repsol International Finance BV, The Hague, Niederlande												
	EUR	1'000.00	16.02.2007	16.02.2017	2 929 036		-	99.602	16.02. 16.02.	4.750	50.757 4.241	N
Emissionsdisagio von 0.398% 16.2.2017 Em.preis: 99.602%												
	EUR	100'000.00	20.09.2012	20.02.2018	19 536 535	%	100.530	99.654	20.02.	4.375	4'669.50	N
	EUR	100'000.00	19.01.2012	19.02.2019	14 751 980	%	105.390	99.937	19.02.	4.875	5'203.16	N
	EUR	100'000.00	28.05.2013	28.05.2020	21 412 352	%	105.890	99.414	28.05.	2.625	2'864.26	N
Republic of Croatia, Kroatien												
	USD	1'000.00	24.03.2011	24.03.2021	12 721 558	%	109.920	98.250	24.03. 24.09.	6.375	31.770 31.575	N
Republic of Latvia, Riga, Lettland												
	EUR	1'000.00	05.03.2008	05.03.2018	3 841 077	%	100.840	99.774	05.03.	5.500	58.946	N
	EUR	1'000.00	21.01.2014	21.01.2021	23 406 567	%	108.800	98.808	21.01.	2.625	28.249	N
Republic of Panama, Panama City, Panama												
	USD	1'000.00	28.01.2004	28.04.2034	1 777 253	%	137.680	98.636	28.04. 28.10.	8.125	40.440 40.502	N
Republic of Singapore, Singapore, Singapur												
	SGD	1'000.00	01.04.2013	01.04.2018	20 036 738	%	99.730	99.655	01.04. 01.10.	0.500	1.790 1.792	N
	SGD	1'000.00	01.06.2011	01.06.2021	13 077 852	%	101.830	99.202	01.06. 01.12.	2.250	7.847 8.240	N
	SGD	1'000.00	01.06.2016	01.06.2026	30 915 129	%	101.060	100.000	01.06. 01.12.	2.125	7.411 7.783	N
Republic of Slovenia, Slowenien												
	EUR	1'000.00	22.03.2007	22.03.2018	3 001 754	%	100.280	98.981	22.03.	4.000	42.766	N
	EUR	1'000.00	06.02.2008	06.02.2019	3 748 769	%	105.090	99.529	06.02.	4.375	46.771	N
	EUR	1'000.00	26.01.2010	26.01.2020	10 935 346	%	109.120	99.888	26.01.	4.125	44.161	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	EUR	1'000.00	18.01.2011	18.01.2021	12 301 044	%	113.940	99.555	18.01.	4.375	46.986	N
	USD	1'000.00	26.10.2012	26.10.2022	19 878 918		-	98.491	26.04.	5.500	27.353	N
Republic of South Africa, Pretoria, Südafrika												
	ZAR	1.00	07.05.2004	15.09.2017	1 841 746		-	87.621	15.03. 15.09.	8.250	0.00316 0.00303	N
Emissionsdisagio von 12.37842% 15.9.2017 Em.preis: 87.62158%									15.09.		0.00903	
	ZAR	1'000.00	13.08.2004	21.12.2018	1 841 771	%	100.810	85.953	21.06. 21.12.	8.000	2.979 0.00312	N
	ZAR	1'000'000.00	24.06.2005	15.01.2020	2 168 338	%	99.840	93.098	15.01. 15.07.	7.250	2'699.72 2'679.68	N
	ZAR	1.00	01.09.2006	31.03.2021	2 741 523	%	97.470	84.737	31.03. 30.09.	6.750	0.00251 0.00241	N
	ZAR	1'000'000.00	21.05.1998	21.12.2026	916 984	%	111.690	78.230	21.06. 21.12.	10.500	3'910.37 4'096.84	N
	ZAR	1'000'000.00	21.07.2006	31.03.2036	2 645 914	%	72.030	77.846	31.03. 30.09.	6.250	2'326.35 2'235.01	N
	ZAR	1'000'000.00	04.06.2010	28.02.2041	11 399 169	%	70.530	75.517	28.02. 31.08.	6.500	2'467.87 2'422.73	N
Republic of the Philippines, Manila, Philippinen												
	USD	1'000.00	18.01.2002	18.01.2017	1 357 440		-	99.331	18.01. 18.01.	9.375	46.949 6.700	N
Emissionsdisagio von 0.669% 18.1.2017 Em.preis: 99.331%												
	USD	1'000.00	15.01.1999	15.01.2019	990 479	%	108.180	98.318	15.01. 15.07.	9.875	49.917 47.547	N
18.1.2017 Rückkauf ausstehender Titel: 1'000 = USD 1'171.25 in bar												
	USD	1'000.00	21.10.1999	21.10.2024	1 009 712	%	142.860	99.689	21.04. 21.10.	9.500	47.439 46.828	N
18.1.2017 Rückkauf ausstehender Titel: 1'000 = USD 1'472.50 in bar												
	USD	1'000.00	16.03.2000	16.03.2025	1 061 279	%	150.990	99.368	16.03. 16.09.	10.625	52.880 51.014	N
18.1.2017 Rückkauf ausstehender Titel: 1'000 = USD 1'568.75 in bar												
Republic of Venezuela, Caracas, Venezuela												
	USD	1'000.00	06.08.1998	15.08.2018	939 875	%	43.840	97.639	15.02. 15.08.	13.625	68.698 66.276	N
	USD	1'000.00	27.09.2001	15.08.2018	3 655 826	%	38.180	100.000	15.02. 15.08.	13.625	68.698 66.276	N
	USD	1'000.00	01.12.2003	01.12.2018	1 732 489	%	35.000	100.000	01.06. 01.12.	7.000	33.930 34.445	N
	USD	1'000.00	21.04.2005	21.04.2025	2 122 225	%	22.000	100.000	21.04. 21.10.	7.650	38.201 37.709	N
	USD	1'000.00	18.09.1997	15.09.2027	713 721	%	25.760	93.501	15.03. 15.09.	9.250	46.624 44.413	N
	USD	1'000.00	14.01.2004	13.01.2034	1 763 217	%	21.250	92.976	13.01. 13.07.	9.375	47.336 45.360	N
Republica Argentina, Buenos Aires, Argentinien												
	USD	1.00	02.06.2010	02.06.2017	11 278 981		-	90.110	02.06. 02.06.	8.750	0.04216 0.09532	N
Emissionsdisagio von 9.89% 2.6.2017 Em.preis: 90.11%												
	CHF	5'000.00	12.04.2017	12.10.2020	36 182 445	%	103.600	100.000	12.10.	3.375	84.375	N
	USD	1.00	31.12.2003	31.12.2038	2 045 162	%	73.180	100.000	31.03. 30.09.	2.500	0.01251 0.01216	N
	EUR	1.00	30.09.2009	31.12.2038	11 279 843	%	71.300	100.000	31.03. 30.09.	2.260	0.01209 0.0129	N
Republik Finnland, Helsinki, Finnland												
	EUR	1'000.00	08.09.2011	15.04.2017	13 777 772		-	99.746	15.04. 15.04.	1.875	20.027 2.713	N
Emissionsdisagio von 0.254% 15.4.2017 Em.preis: 99.746%												
	EUR	1'000.00	30.05.2006	15.09.2017	2 577 037		-	99.209	15.09. 15.09.	3.875	44.517 9.087	N
Emissionsdisagio von 0.791% 15.9.2017 Em.preis: 99.209%												
	EUR	1'000.00	04.09.2013	15.09.2018	22 241 836	%	101.280	99.733	15.09.	1.125	12.924	N
	EUR	1'000.00	28.04.2008	04.07.2019	3 981 239	%	107.550	99.425	04.07.	4.375	47.925	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	EUR	1'000.00	16.03.2010	15.04.2020	11 118 495	%	108.850	99.911	15.04.	3.375	36.050	N
	EUR	1'000.00	03.09.2014	15.09.2020	25 330 116	%	102.260	99.407	15.09.	0.375	4.308	N
	EUR	1'000.00	22.02.2011	15.04.2021	12 517 680	%	112.690	99.161	15.04.	3.500	37.385	N
	EUR	1'000.00	04.09.2012	15.09.2022	19 380 617	%	108.390	98.895	15.09.	1.625	18.668	N
	EUR	1'000.00	16.04.2013	15.04.2023	21 135 675	%	108.130	99.183	15.04.	1.500	16.022	N
Republik Kolumbien, Kolumbien												
	USD	1'000.00	25.02.2000	25.02.2020	1 051 293	%	119.250	97.530	25.02. 25.08.	11.750	59.079 56.305	N
	USD	1'000.00	21.01.2004	21.05.2024	1 768 437	%	126.890	95.154	21.05. 21.11.	8.125	39.516 40.313	N
	USD	1'000.00	28.01.2003	28.01.2033	1 547 629	%	157.200	92.514	28.01. 28.07.	10.375	51.727 50.252	N
Republik Oesterreich, Wien, Österreich												
Emissionsdisagio von 0.447% 15.9.2017 Em.preis: 99.553%	EUR	1'000.00	21.09.2007	15.09.2017	3 421 732		-	99.553	15.09. 15.09.	4.300	49.400 5.135	N
	EUR	1'000.00	22.01.2003	15.01.2018	1 544 591	%	100.150	99.744	15.01.	4.650	49.991	N
	EUR	1'000.00	27.09.2013	19.10.2018	22 447 489	%	101.290	99.848	19.10.	1.150	13.282	N
	EUR	1'000.00	15.01.2008	15.03.2019	3 674 738	%	105.880	99.900	15.03.	4.350	46.616	N
	EUR	1'000.00	03.07.2012	18.06.2019	18 927 607	%	103.610	99.551	18.06.	1.950	21.209	N
	EUR	1'000.00	07.10.2014	18.10.2019	25 614 553	%	101.310	99.746	18.10.	0.250	2.890	N
	EUR	1'000.00	18.01.2005	15.07.2020	2 044 588	%	111.130	99.149	15.07.	3.900	43.081	N
	EUR	1'000.00	16.01.2006	15.09.2021	2 406 702	%	114.350	99.796	15.09.	3.500	40.209	N
	EUR	1'000.00	17.01.2011	20.04.2022	12 324 115	%	116.570	99.662	20.04.	3.650	39.102	N
	EUR	1'000.00	26.01.2012	22.11.2022	10 453 292	%	117.150	99.705	22.11.	3.400	39.406	N
	EUR	1'000.00	17.04.2013	20.10.2023	21 153 933	%	109.980	99.741	20.10.	1.750	20.286	N
	EUR	1'000.00	04.06.2014	21.10.2024	24 571 142	%	110.050	99.504	21.10.	1.650	19.104	N
	EUR	1'000.00	23.06.2015	20.10.2025	28 613 192	%	106.780	99.448	20.10.	1.200	13.911	N
	EUR	1'000.00	15.03.2009	15.03.2026	10 282 318	%	137.030	99.786	15.03.	4.850	51.975	N
	EUR	0.010	15.07.1997	15.07.2027	678 193	%	154.070	99.450	15.07.	6.250	0.00068	N
	EUR	1'000.00	15.03.2006	15.03.2037	2 872 751	%	151.950	99.717	15.03.	4.150	44.473	N
Republik Peru, Lima, Peru												
	USD	1'000.00	21.11.2003	21.11.2033	1 724 456	%	157.620	99.099	21.05. 21.11.	8.750	42.555 43.414	N
Republik Polen, Warszawa, Polen												
Emissionsdisagio von 0.616% 29.3.2017 Em.preis: 99.384%	EUR	1'000.00	29.03.2010	29.03.2017	11 161 760		-	99.384	29.03. 29.03.	3.750	40.194 6.602	N
	CHF	5'000.00	21.04.2008	21.04.2017	3 907 768		-	100.310	21.04.	3.625	181.25	N
Emissionsdisagio von 1.928% 25.10.2017 Em.preis: 98.072%	PLN	1'000.00	25.10.2006	25.10.2017	2 745 162		-	98.072	25.10. 25.10.	5.250	14.479 5.317	N
	CHF	5'000.00	08.05.2015	08.05.2018	28 056 556	%	100.250	100.642	08.05.	0.000	0.000	N
	CHF	5'000.00	15.05.2012	15.05.2018	18 425 026	%	101.090	100.217	15.05.	2.250	112.50	N
	EUR	1'000.00	20.06.2008	20.06.2018	4 323 666	%	102.870	99.865	20.06.	5.625	61.079	N
	EUR	1'000.00	15.01.2013	15.01.2019	20 425 781	%	102.000	99.547	15.01.	1.625	17.470	N
	CHF	5'000.00	15.05.2007	15.05.2019	3 064 403	%	105.200	101.262	15.05.	3.250	162.50	N
	USD	1'000.00	15.07.2009	15.07.2019	10 344 836	%	105.780	99.788	17.01. 15.07.	6.375	31.961 30.353	N
	EUR	1'000.00	18.01.2005	15.04.2020	2 044 906	%	109.750	99.375	15.04.	4.200	44.862	N
	CHF	5'000.00	17.09.2014	17.09.2021	24 790 455	%	103.850	100.515	17.09.	1.000	50.000	N
	EUR	1'000.00	14.10.2015	14.10.2021	30 042 488	%	103.420	99.623	14.10.	0.875	10.066	N
	EUR	1'000.00	18.01.2007	18.01.2022	2 875 040	%	118.300	99.700	18.01.	4.500	48.329	N
	EUR	1'000.00	18.06.2012	19.01.2023	18 819 195	%	117.410	99.810	19.01.	3.750	40.327	N
	EUR	1'000.00	15.01.2014	15.01.2024	23 320 913	%	115.360	99.727	15.01.	3.000	32.252	N
	EUR	1'000.00	09.10.2012	09.07.2024	19 734 902	%	118.050	99.915	09.07.	3.375	37.160	N
	EUR	1'000.00	20.01.2010	20.01.2025	10 910 696	%	130.010	98.795	20.01.	5.250	56.513	N
	EUR	1'000.00	09.09.2015	09.09.2025	29 555 951	%	105.630	99.156	09.09.	1.500	17.112	N
Republik Ungarn, Ungarn												
Emissionsdisagio von 0.616% 4.7.2017 Em.preis: 99.384%	EUR	1'000.00	01.02.2007	04.07.2017	2 900 969		-	99.384	 04.07. 04.07.	4.375	 6.747 47.925	N
Emissionsdisagio von 0.6467% 24.11.2017 Em.preis: 99.3533%	HUF	10'000.00	15.11.2001	24.11.2017	1 326 151		-	99.353	24.11. 24.11.	6.750	2.529 0.24231	N
	HUF	10'000.00	06.02.2008	24.06.2019	3 769 912	%	109.500	95.338	24.06.	6.500	2.283	N
	EUR	1'000.00	24.02.2005	24.02.2020	2 073 738	%	108.390	99.152	24.02.	3.875	41.341	N
	HUF	10'000.00	11.02.2004	12.11.2020	1 791 629	%	119.670	93.681	12.11.	7.500	2.793	N
	HUF	10'000.00	10.01.2007	24.11.2023	2 862 603	%	126.550	96.093	24.11.	6.000	2.248	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Republique du Senegal, Dakar, Senegal												
	USD	1'000.00	13.05.2011	13.05.2021	13 005 766	%	112.850	97.574	13.05. 13.11.	8.750	43.602 43.553	N
	USD	1'000.00	13.05.2011	13.05.2021	12 995 235	%	114.800	97.574	13.05. 13.11.	8.750	43.602 43.553	N
Republique Francaise, Paris, Frankreich												
	EUR	1.00	24.07.2012	25.07.2017	19 050 331		-	100.680	25.07.	1.000	0.01106	N
Emissionsdisagio von 0.83% 25.10.2017 Em.preis: 99.17%	EUR	1.00	11.09.2007	25.10.2017	3 384 251		-	99.170	25.10. 25.10.	4.250	0.04969 0.0097	N
	EUR	1.00	23.03.2015	25.02.2018	27 510 806	%	100.110	100.334	25.02.	0.000	0.000	N
	EUR	1.00	22.01.2013	25.05.2018	20 450 940	%	100.630	99.710	25.05.	1.000	0.0109	N
	EUR	1.00	07.10.2008	25.10.2018	4 621 974	%	103.850	98.550	25.10.	4.250	0.04969	N
	EUR	1.00	25.06.2013	25.11.2018	21 654 517	%	101.350	98.720	25.11.	1.000	0.01169	N
	EUR	1.00	10.06.2003	25.04.2019	1 611 618	%	106.370	99.850	25.04.	4.250	0.04612	N
Tranche 3	EUR	1.00	25.01.1989	25.10.2019	926 485	%	116.460	95.800	25.10.	8.500	0.09938	N
	EUR	1.00	07.07.2009	25.10.2019	10 318 973	%	107.870	99.370	25.10.	3.750	0.04384	N
	EUR	1.00	24.06.2014	25.11.2019	24 701 728	%	101.970	99.020	25.11.	0.500	0.00584	N
	EUR	1.00	09.02.2010	25.04.2020	10 983 677	%	109.200	99.300	25.04.	3.500	0.03798	N
	EUR	1.00	12.10.2010	25.10.2020	11 845 353	%	108.270	98.420	25.10.	2.500	0.02923	N
	EUR	1.00	21.09.2015	25.11.2020	29 698 121	%	101.790	99.669	25.11.	0.250	0.00292	N
	EUR	1.00	10.05.2005	25.04.2021	2 137 338	%	113.640	99.920	25.04.	3.750	0.04069	N
	EUR	1.00	07.06.2011	25.10.2021	13 110 948	%	113.540	97.880	25.10.	3.250	0.038	N
	EUR	1.00	12.02.1992	25.04.2022	927 016	%	136.730	98.640	25.04.	8.250	0.08953	N
	EUR	1.00	07.02.2012	25.04.2022	14 880 854	%	113.810	98.900	25.04.	3.000	0.03255	N
	EUR	1.00	09.10.2012	25.10.2022	19 699 643	%	111.380	99.750	25.10.	2.250	0.0263	N
	EUR	1.00	27.01.1992	25.04.2023	927 059	%	145.410	101.650	25.04.	8.500	0.09225	N
	EUR	1.00	07.05.2013	25.05.2023	21 278 085	%	109.580	99.450	25.05.	1.750	0.01907	N
	EUR	1.00	09.05.2007	25.10.2023	3 082 934	%	124.570	98.360	25.10.	4.250	0.04969	N
	EUR	1.00	12.11.2013	25.05.2024	22 767 907	%	113.620	98.500	25.05.	2.250	0.02452	N
	EUR	1.00	10.06.2014	25.11.2024	24 584 017	%	110.590	98.007	25.11.	1.750	0.02045	N
	EUR	1.00	09.02.2015	25.05.2025	26 983 694	%	101.620	98.865	25.05.	0.500	0.00545	N
	EUR	1.00	25.02.1994	25.10.2025	927 157	%	144.500	95.290	25.10.	6.000	0.07015	N
	EUR	1.00	07.09.2015	25.11.2025	29 506 041	%	104.990	98.017	25.11.	1.000	0.01169	N
	EUR	1.00	06.07.2010	25.04.2026	11 485 328	%	125.690	99.470	25.04.	3.500	0.03798	N
	EUR	1.00	12.06.2001	25.10.2032	1 248 684		n.v.	99.530	25.10.	5.750	0.06723	N
Republique Turquie, Ankara, Türkei												
Emissionsdisagio von 1.663% 16.2.2017 Em.preis: 98.337%	EUR	1'000.00	16.02.2005	16.02.2017	2 067 825		-	98.337	16.02. 16.02.	5.500	58.771 17.721	N
	EUR	1'000.00	12.11.2013	12.11.2021	22 814 292	%	108.850	99.339	12.11.	4.350	50.512	N
	USD	1'000.00	24.01.2005	05.02.2025	2 047 353	%	115.100	98.507	06.02. 05.08.	7.375	36.605 35.658	N
	USD	1'000.00	18.01.2000	15.01.2030	1 035 720	%	157.090	99.604	15.01. 15.07.	11.875	60.027 57.177	N
	USD	1'000.00	14.01.2004	14.02.2034	1 763 316	%	123.380	97.437	14.02. 14.08.	8.000	40.323 38.805	N
Residual Debt Services Limited, Halfway House, Südafrika												
Notes 2016-Without Fixed Maturity Tranche 1 Floating Rate	ZAR	1.00	04.04.2016		32 105 978	%	78.000	100.000	10.02. 10.05. 10.08. 10.11.	VAR.	0.00195 0.00189 0.00188 0.0018	N
Reynolds American Inc., Winston-Salem, USA												
	USD	1'000.00	31.10.2012	01.11.2022	19 903 216	%	100.450	99.864	01.05. 01.11.	3.250	16.151 16.271	N
Rheinmetall AG, Düsseldorf, Deutschland												
Emissionsdisagio von 0.878% 22.9.2017 Em.preis: 99.122%	EUR	1'000.00	22.09.2010	22.09.2017	11 771 437		-	99.122	22.09. 22.09.	VAR.	60.881 10.181	N
Rickmers Holding AG, Hamburg, Deutschland												
	EUR	1'000.00	11.06.2013	11.06.2018	21 426 036	%	2.600	100.000	11.06.	8.875	96.351	N
Rio Tinto Finance PLC, London, Grossbritannien												
	EUR	1'000.00	11.12.2012	11.12.2024	20 185 551	%	114.590	98.815	11.12.	2.875	33.592	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Rio Tinto Finance USA Ltd, Australien												
	USD	1'000.00	19.09.2011	20.09.2021	13 884 706	%	103.770	99.744	20.03. 20.09.	3.750	18.687 18.034	N
22.5.2017 Rückkauf ausstehender Titel												
Rio Tinto Finance (USA) PLC, London, Grossbritannien												
	USD	1'000.00	22.03.2012	22.03.2022	18 229 967	%	102.290	99.474	22.03. 22.09.	3.500	17.321 16.955	N
	USD	1'000.00	21.08.2012	21.08.2022	19 308 205	%	100.350	98.688	21.02. 21.08.	2.875	14.512 13.805	N
22.5.2017 Rückkauf ausstehender Titel												
Robert Bosch GmbH, Deutschland												
	EUR	50'000.00	12.06.2009	12.06.2017	10 250 773		-	99.936	12.06. 12.06.	5.125	2'781.97 34.740	N
Emissionsdisagio von 0.064% 12.6.2017 Em.preis: 99.936%												
Roche Finance Europe BV, Woerden, Niederlande												
	EUR	1'000.00	23.03.2012	25.06.2018	18 193 102	%	101.000	99.812	25.06.	2.000	21.741	N
	GBP	1'000.00	29.08.2003	29.08.2023	1 665 530	%	121.390	98.718	29.08.	5.375	65.930	N
Roche Holdings Inc, San Francisco, USA												
	USD	1'000.00	13.03.2015	13.03.2020	27 389 005	%	99.580	99.592	13.03.	2.000	20.136	N
	USD	1'000.00	29.09.2014	29.09.2021	25 527 376	%	101.200	99.723	29.03. 29.09.	2.875	14.332 13.908	N
	USD	1'000.00	31.10.2016	28.01.2022	34 389 297	%	97.110	99.634	28.07.	1.750	12.620	N
Rogers Communications Inc., Toronto, Kanada												
	USD	1'000.00	06.08.2008	15.08.2018	4 470 661	%	102.460	99.854	15.02. 15.08.	6.800	34.286 33.077	N
Rolls-Royce plc, London, Grossbritannien												
	GBP	1'000.00	30.04.2009	30.04.2019	10 145 294	%	107.600	99.028	30.04.	6.750	86.739	N
Rosneft International Finance Limited, Dublin 1, Irland												
	USD	1'000.00	06.12.2012	06.03.2017	20 145 900		-	100.000	06.03.	3.149	15.922	N
Royal Bank of Canada, Toronto, Kanada												
	EUR	1'000.00	22.01.2008	22.01.2018	3 683 363	%	100.260	99.225	22.01.	4.625	49.773	N
	NZD	2'000.00	18.12.2014	17.01.2020	26 406 571	%	103.300	100.963	17.01.	4.625	66.846	N
Royal Bank of Canada, Montreal, Kanada												
	USD	1'000.00	01.10.2013	01.10.2018	22 447 701	%	99.800	99.924	01.04. 01.10.	2.000	10.030 9.734	N
	CAD	1'000.00	11.10.2013	11.10.2018	22 602 241	%	100.840	99.991	11.04. 11.10.	2.890	10.863 11.259	N
	CHF	5'000.00	23.10.2013	23.10.2018	22 448 636	%	101.140	100.146	23.10.	0.750	37.500	N
	CHF	5'000.00	09.04.2014	09.04.2019	23 949 867	%	101.480	100.586	09.04.	0.625	31.250	N
Tranche 193	USD	1'000.00	30.10.2015	30.10.2020	30 228 638	%	99.920	99.953	30.04. 30.10.	2.350	11.678 11.714	N
	CHF	5'000.00	21.04.2011	21.04.2021	12 759 314	%	108.600	100.706	21.04.	2.250	112.50	N
Royal Bank of Canada, Sydney Branch, Sydney NSW, Australien												
	AUD	1'000.00	07.08.2015	07.08.2018	29 113 112	%	100.250	99.430	07.02. 07.08.	2.750	10.477 10.485	N
	AUD	1'000.00	10.02.2015	10.02.2020	26 979 997	%	101.400	99.714	10.02. 10.08.	3.250	12.630 12.256	N
Royal Schiphol Group N.V., Schiphol, Niederlande												
	EUR	1'000.00	28.04.2011	28.04.2021	12 915 476	%	112.830	100.000	28.04.	4.430	48.021	N
RSHB Capital SA, Luxemburg												
	USD	1'000.00	16.10.2013	16.10.2023	22 541 953	%	111.000	100.000	18.04. 16.10.	8.500	42.442 41.444	N
RTE EDF Transport S.A., La Defense, Frankreich												
	EUR	50'000.00	12.09.2008	12.09.2018	4 539 365	%	103.720	99.274	12.09.	5.125	2'939.57	N
	EUR	50'000.00	28.06.2010	28.06.2022	11 437 741	%	115.940	99.172	28.06.	3.875	2'113.90	N
Rumaenien, Rumänien												
	EUR	1'000.00	18.06.2008	18.06.2018	4 318 741	%	103.020	98.590	18.06.	6.500	70.697	N
	EUR	1'000.00	07.11.2012	07.11.2019	19 953 944	%	109.270	99.047	07.11.	4.875	56.376	N
	EUR	1'000.00	18.09.2013	18.09.2020	22 363 047	%	112.480	99.160	18.09.	4.625	53.092	N
	EUR	1'000.00	24.04.2014	24.04.2024	24 268 064	%	115.630	99.374	24.04.	3.625	39.198	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	EUR	1'000.00	28.10.2014	28.10.2024	25 858 298	%	110.780	99.163	28.10.	2.875	33.328	N
	EUR	1'000.00	29.10.2015	29.10.2025	30 191 766	%	108.740	99.183	29.10.	2.750	31.879	N
Rural Electrification Corp Ltd, New Delhi, Indien												
	CHF	5'000.00	07.03.2012	07.03.2017	14 860 614		-	100.432	07.03.	3.500	175.00	N
Russische Foederation, Moscow, Russland												
	RUB	1'000.00	06.02.2013	31.01.2018	20 661 977	%	99.900	100.106	01.02. 02.08.	6.200	0.50991 0.49263	N
	RUB	5'000'000.00	10.03.2011	10.03.2018	12 588 256	%	99.950	100.000	10.03. 10.09.	7.850	3'361.17 3'268.54	N
	RUB	1'000.00	04.09.2013	16.08.2023	22 270 552	%	100.090	97.660	22.02. 23.08.	7.000	0.60991 0.56991	N
RWE AG, Essen, Deutschland												
4.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	04.11.2011	04.04.2072	13 659 435		-	101.000	04.04.	5.250	262.50	N
26.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	26.07.2012	26.07.2072	18 584 304		-	101.000	26.07.	5.000	250.00	N
26.9.2017 Rückkauf ausstehender Titel: 1'000 = EUR 1'028.50 in bar	EUR	1'000.00	21.04.2015	21.04.2075	27 912 165	%	103.500	99.382	21.10.	2.750	31.840	N
RZD Capital PLC, Dublin, Irland												
	CHF	5'000.00	26.02.2013	26.02.2018	20 581 943	%	100.280	100.000	26.02.	2.177	108.85	N
	CHF	5'000.00	26.02.2013	26.02.2021	20 581 944	%	104.300	100.000	26.02.	2.730	136.50	N
	CHF	5'000.00	02.10.2017	02.10.2023	37 926 874	%	100.400	100.000		2.100	0.000	N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Saab AB, Linkoping, Schweden												
	SEK	1'000'000.00	12.06.2014	12.12.2019	24 642 861	%	101.150	100.000	13.03. 12.06. 12.09. 12.12.	VAR.	179.74 212.82 229.42 246.29	N
Sachsen-Anhalt (Land), Magdeburg, Deutschland												
Emissionsdisagio von 0.725% 11.9.2017 Em.preis: 99.275%	EUR	1'000.00	10.09.2007	11.09.2017	3 398 842		-	99.275	11.09. 11.09.	4.500	51.338 8.271	N
SAF-Holland S.A., Luxemburg												
	EUR	1'000.00	31.10.2012	26.04.2018	19 861 638	%	101.900	100.000	26.04.	7.000	75.729	N
Saint-Gobain (Compagnie de), Courbevoie, Frankreich												
Emissionsdisagio von 0.164% 11.4.2017 Em.preis: 99.836%	EUR	1'000.00	11.04.2007	11.04.2017	3 028 300		-	99.836	11.04. 11.04.	4.750	50.796 1.753	N
	EUR	1'000.00	08.10.2010	08.10.2018	11 826 525	%	102.990	99.691	08.10.	4.000	45.992	N
	EUR	1'000.00	30.09.2011	30.09.2019	13 945 445	%	107.800	99.363	30.09.	4.500	51.410	N
	EUR	1'000.00	15.06.2012	15.06.2021	18 749 133	%	111.450	99.856	15.06.	3.625	39.401	N
	EUR	1'000.00	28.03.2012	28.03.2022	18 193 223	%	113.400	99.031	28.03.	3.625	38.747	N
San Miguel Industrias PET SA, Lima, Peru												
29.8.2017 Rückkauf ausstehender Titel: 1'000 = USD 1'016.53 in bar 22.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	06.11.2013	06.11.2020	22 763 048		-	100.000	06.05. 22.09.	7.750	38.648 28.366	N
Sandvik AB, Sandviken, Schweden												
	SEK	100'000.00	14.05.2014	14.01.2021	24 452 937	%	101.870	100.000	16.01. 18.04. 14.07. 16.10.	VAR.	19.635 17.262 19.856 21.497	N
SANHA GmbH & Co. KG, Essen, Deutschland												
	EUR	1'000.00	04.06.2013	04.06.2023	21 311 425	%	80.880	100.000	04.06.	7.750	84.118	N
Sanofi, Paris, Frankreich												
Emissionsdisagio von 0.242% 14.11.2017 Em.preis: 99.758%	EUR	1'000.00	14.11.2012	14.11.2017	19 995 097		-	99.758	14.11. 14.11.	1.000	11.657 2.821	N
Emissionsdisagio von 0.439% 3.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	10.04.2013	10.04.2018	21 087 764		-	99.561	10.04. 03.09. 03.09.	1.250	6.300 4.747 4.197	N
	EUR	1'000.00	12.10.2009	11.10.2019	10 630 769	%	107.690	99.823	11.10.	4.125	47.513	N
	EUR	100'000.00	13.09.2016	13.01.2020	33 876 915	%	100.160	100.167	13.01.	0.000	0.000	N
	USD	1'000.00	29.03.2011	29.03.2021	12 749 316	%	105.140	98.976	29.03. 29.09.	4.000	19.941 19.351	N
Santander Consumer Bank AS, Lysaker, Norwegen	EUR	100'000.00	13.09.2016	13.09.2022	33 885 438	%	98.610	99.539		0.000	0.000	Y
	EUR	100'000.00	29.09.2016	30.09.2019	34 051 956	%	100.310	99.642	30.09.	0.250	286.39	N
Santander Consumer Finance S.A., Boadilla De Monte, Spanien												
(no min.) Notes 2016-23.2.18 Tranche 1	CHF	5'000.00	23.03.2016	23.02.2018	31 420 937	%	100.100	100.000	23.02. 23.05. 23.08. 23.11.	VAR.	3.910 4.000 4.100 4.140	N
	CHF	5'000.00	05.10.2015	05.10.2020	29 298 444	%	101.050	100.519	05.10.	0.500	25.000	N
Tranche 2	CHF	5'000.00	23.03.2016	23.03.2021	31 699 463	%	101.400	100.320	23.03.	0.600	30.000	N
Santander International Debt S.A.U., Boadilla del Monte, Spanien												
Emissionsdisagio von 0.049% 27.3.2017 Em.preis: 99.951%	EUR	100'000.00	27.03.2012	27.03.2017	18 177 815		-	99.951	27.03. 27.03.	4.000	4'281.40 52.447	N
Emissionsdisagio von 0.155% 4.10.2017 Em.preis: 99.845%	EUR	50'000.00	04.10.2010	04.10.2017	11 782 743		-	99.845	04.10. 04.10.	4.125	2'363.21 88.799	N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Santos Finance Ltd, Australien												
	EUR	1'000.00	22.09.2010	22.09.2070	11 772 549		-	100.000	22.03. 22.09.	8.250	43.739 48.228	N
22.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
SAP SE, Walldorf, Deutschland												
	EUR	1'000.00	08.04.2010	10.04.2017	11 190 186		-	99.780	10.04. 10.04.	3.500	37.395 2.350	N
Emissionsdisagio von 0.22% 10.4.2017 Em.preis: 99.78%												
	EUR	1'000.00	13.11.2012	13.11.2019	19 985 162	%	104.450	99.307	13.11.	2.125	24.675	N
	EUR	1'000.00	20.11.2014	20.02.2023	26 104 890	%	104.540	99.478	20.02.	1.125	12.007	N
	EUR	1'000.00	01.04.2015	01.04.2025	27 699 728	%	103.600	99.264	01.04.	1.000	10.685	N
SB Capital SA, Luxemburg												
	CHF	5'000.00	28.02.2013	28.02.2017	20 447 727		-	100.000	28.02.	2.065	103.25	N
	USD	1'000.00	24.09.2010	24.03.2017	11 779 999		-	100.000	24.03.	5.400	26.762	N
	TRY	1'000.00	04.03.2013	04.03.2018	20 802 537	%	98.320	100.000	04.03. 04.09.	7.400	10.085 10.312	N
	EUR	1'000.00	26.06.2014	15.11.2019	24 771 842	%	104.580	100.000	15.11.	3.352	39.154	N
	USD	1'000.00	23.05.2013	23.05.2023	21 445 823	%	103.000	100.000	23.05. 23.11.	5.250	25.504 25.773	N
SBAB Bank AB, Stockholm, Schweden												
	CHF	5'000.00	06.12.2011	06.12.2018	14 288 200	%	102.410	100.004	06.12.	2.000	100.00	N
Schaeffler Finance BV, Barneveld, Niederlande												
	EUR	1'000.00	14.05.2014	15.05.2022	24 420 734	%	101.680	100.000	15.05. 15.11.	3.500	19.147 20.439	N
Schlumberger Holdings Corp, USA												
	USD	1'000.00	21.12.2015	21.12.2018	30 769 071	%	100.110	99.988	21.06. 21.12.	2.350	11.453 11.622	N
	USD	1'000.00	21.12.2015	21.12.2020	30 769 072	%	101.270	99.774	21.06. 21.12.	3.000	14.621 14.836	N
Schlumberger Investment SA, Luxemburg												
	USD	1'000.00	31.07.2012	01.08.2022	19 129 029	%	98.720	99.832	01.02. 01.08.	2.400	11.907 11.587	N
Schneider Electric SE, Rueil Malmaison, Frankreich												
	EUR	1'000.00	11.08.2005	11.08.2017	2 240 878		-	99.225	11.08. 11.08.	4.000	45.410 8.798	N
Emissionsdisagio von 0.775% 11.8.2017 Em.preis: 99.225%												
	EUR	100'000.00	12.07.2011	12.07.2018	13 304 181	%	101.870	99.354	12.07.	3.750	4'128.93	N
	USD	1'000.00	27.09.2012	27.09.2022	19 624 769	%	99.280	99.734	27.03. 27.09.	2.950	14.504 14.377	N
Schoen Klinik SE, Prien am Chiemsee, Deutschland												
	CHF	5'000.00	30.05.2014	30.05.2019	24 062 590	%	103.200	100.500	30.05.	3.250	162.50	N
Scor SE, Puteaux, Frankreich												
	CHF	5'000.00	08.10.2012		19 483 636	%	102.100	101.000	08.06.	5.250	262.50	N
	CHF	5'000.00	30.09.2013		22 332 199	%	104.000	101.000	30.11.	5.000	250.00	N
Notes 2014-Open End Variable Rate	CHF	5'000.00	20.10.2014		25 549 745	%	105.850	101.000	20.10.	3.375	168.75	N
Scottish Power plc, Glasgow, Grossbritannien												
	GBP	1'000.00	20.02.1997	20.02.2017	581 301		-	100.708	20.02.	8.375	104.69	N
Seadrill Limited, Hamilton, Bermuda												
	USD	1'000.00	25.09.2013	15.09.2020	22 423 964	%	11.000	100.000	15.03. 15.09.	VAR.	33.392 31.809	N
Securitas AB, Stockholm, Schweden												
	EUR	1'000.00	28.02.2012	28.02.2017	18 051 298		-	99.430	28.02. 28.02.	2.750	29.344 6.065	N
Emissionsdisagio von 0.57% 28.2.2017 Em.preis: 99.43%												
Selecta Group B.V., Amsterdam, Niederlande	EUR	1'000.00	14.09.2012	14.03.2018	19 482 179	%	100.350	99.578	14.03.	2.250	24.136	N
	CHF	1'000.00	20.06.2014	15.06.2020	24 701 993	%	98.790	100.000	15.06. 15.12.	6.500	32.500 32.500	N
Severn Trent Utilities Finance PLC, Coventry, Grossbritannien												
	GBP	1'000.00	22.01.2009	22.01.2018	4 970 898	%	100.250	99.258	22.01.	6.000	75.052	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
SG Development GmbH, Duesseldorf, Deutschland												
	CHF	1'000.00	30.11.2015	01.12.2020	30 598 969	%	100.700	100.000	30.05. 30.11.	4.125	20.625 20.625	N
Shell International Finance BV, S-Gravenhage, Niederlande												
	EUR	50'000.00	22.05.2007	22.05.2017	3 112 883		-	99.725		4.625		N
Emissionsdisagio von 0.275% 22.5.2017 Em.preis: 99.725%									22.05.		150.44	
	USD	1'000.00	21.08.2012	21.08.2017	19 289 106		-	99.425	21.02. 21.08.	1.125	5.678 5.401	N
Emissionsdisagio von 0.575% 21.8.2017 Em.preis: 99.425%									21.08.		5.522	
	EUR	1'000.00	13.05.2009	14.05.2018	10 174 583	%	101.570	99.178	14.05.	4.375	47.869	N
	USD	1'000.00	12.08.2013	10.08.2018	22 099 943	%	99.740	99.934	10.02. 10.08.	1.900	9.546 9.157	N
	USD	1'000.00	25.03.2010	25.03.2020	11 153 569	%	104.460	99.528	25.03. 25.09.	4.375	21.511 21.198	N
	USD	1'000.00	11.05.2015	11.05.2020	28 185 052	%	99.710	99.788	11.05. 11.11.	2.125	10.698 10.577	N
	EUR	1'000.00	24.03.2014	24.03.2021	24 023 192	%	104.960	99.489	24.03.	1.625	17.404	N
	USD	1'000.00	21.08.2012	21.08.2022	19 289 108	%	98.990	99.567	21.02. 21.08.	2.375	11.988 11.404	N
	USD	1'000.00	06.12.2012	06.01.2023	20 145 674	%	98.000	98.990	06.01. 06.07.	2.250	11.403 10.832	N
	CHF	5'000.00	21.08.2015	21.08.2023	29 287 788	%	102.000	100.651	21.08.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	21.08.2015	21.08.2028	29 287 789	%	105.400	101.418	21.08.	0.875	43.750	N
Shenton Finance PLC, London, Grossbritannien	USD	1'000.00	11.12.2008	15.12.2038	4 900 153	%	139.120	99.469	15.06. 15.12.	6.375	31.073 31.614	N
	EUR	1.00	27.06.2017	27.06.2020	37 490 711	%	101.590	100.000	27.12.	6.500	0.0383	N
Siemens Financieringsmaatschappij Nv, Den Haag, Niederlande												
	EUR	1'000.00	20.02.2009	20.02.2017	3 375 789		-	99.264	20.02.	5.125	54.699	N
Emissionsdisagio von 0.736% 20.2.2017 Em.preis: 99.264%									20.02.		7.833	
	EUR	1'000.00	11.06.2008	11.06.2018	4 298 721	%	102.650	99.903	11.06.	5.625	61.067	N
	EUR	1'000.00	10.09.2012	10.03.2020	19 396 297	%	103.600	99.526	10.03.	1.500	16.147	N
SingTel Group Treasury Pte Ltd, Singapore, Singapur	EUR	1'000.00	12.03.2013	12.03.2021	20 839 837	%	105.610	99.535	12.03.	1.750	18.798	N
	USD	1'000.00	08.03.2012	08.09.2017	18 112 417		-	99.795	08.03. 08.09.	2.375	12.048 11.254	N
Emissionsdisagio von 0.205% 8.9.2017 Em.preis: 99.795%									08.09.		1.942	
Sinochem Offshore Capital Co Ltd, Britische Jungferninseln	USD	1'000.00	08.03.2011	08.09.2021	12 616 667	%	106.420	99.298	08.03. 08.09.	4.500	22.828 21.324	N
	CHF	5'000.00	17.06.2015	17.06.2022	28 201 897	%	102.000	100.000	17.06.	0.760	38.000	N
Sixt SE, Pullach, Deutschland												
	EUR	1'000.00	16.05.2012	16.05.2018	18 596 471	%	101.330	99.847	16.05.	3.750	41.030	N
Sk Telecom Co Ltd, Seoul, Korea (Republik)												
	CHF	5'000.00	12.06.2012	12.06.2017	18 613 044		-	100.246	12.06.	1.750	87.500	N
Slovak Republic, Slovakische Republik												
	EUR	1.00	19.01.2012	19.01.2017	14 741 853		-	99.690	19.01.	4.625	0.04973	N
Emissionsdisagio von 0.31% 19.1.2017 Em.preis: 99.69%									19.01.		0.00332	
	CHF	5'000.00	25.04.2012	25.04.2018	18 137 977	%	100.900	100.559	25.04.	2.125	106.25	N
	EUR	1.00	28.05.2013	28.11.2018	21 496 617	%	101.470	99.522	28.11.	1.500	0.01752	N
	CHF	5'000.00	16.04.2013	16.10.2019	20 659 449	%	103.200	100.427	16.10.	1.375	68.750	N
	EUR	1.00	27.04.2010	27.04.2020	11 241 560	%	110.330	99.563	27.04.	4.000	0.04323	N
	EUR	1'000.00	27.03.2006	26.03.2021	2 499 265	%	114.700	99.490	27.03.	4.000	42.814	N
	CHF	5'000.00	25.04.2012	25.04.2022	18 191 558	%	112.400	100.261	25.04.	2.750	137.50	N
	EUR	1.00	28.02.2013	28.02.2023	20 778 079	%	115.250	98.898	28.02.	3.000	0.03201	N
	CHF	5'000.00	16.04.2013	16.10.2023	20 659 450	%	112.000	100.411	16.10.	2.125	106.25	N
	EUR	1.00	15.11.2012	15.11.2024	19 995 112	%	120.000	99.553	15.11.	3.375	0.03941	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	EUR	1.00	14.10.2010	14.10.2025	11 859 704	%	131.980	99.751	14.10.	4.350	0.05004	N
SNAM S.p.A., San Donato Milanese, Italien												
	EUR	1'000.00	19.07.2012	18.01.2019	19 044 749	%	105.350	99.851	18.01.	5.000	53.699	N
SNCF MOBILITES, Paris, Frankreich												
	CHF	5'000.00	11.06.2009	11.06.2018	10 176 806	%	101.550	100.357	11.06.	2.750	137.50	N
	EUR	1'000.00	10.07.2003	10.07.2018	1 634 569	%	102.010	99.004	10.07.	4.375	48.170	N
	CHF	5'000.00	03.03.2009	23.01.2019	2 062 677	%	103.650	101.013	23.01.	2.750	137.50	N
	CHF	5'000.00	24.11.2009	24.07.2019	10 694 250	%	104.500	100.361	24.07.	2.375	118.75	N
	EUR	1'000.00	03.06.2005	03.06.2020	2 168 939	%	109.040	98.979	03.06.	3.625	39.345	N
	CHF	5'000.00	25.02.2011	25.02.2021	12 338 575	%	107.850	101.061	25.02.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	13.12.2006	13.12.2021	2 781 528	%	111.100	101.880	13.12.	2.625	131.25	N
SNCF Reseau, Paris, Frankreich												
	CHF	5'000.00	24.07.2009	24.04.2019	10 307 823	%	105.050	101.357	24.04.	3.000	150.00	N
	EUR	1'000.00	12.10.2000	12.10.2020	1 137 991	%	117.830	98.468	12.10.	6.000	69.384	N
	CHF	5'000.00	26.02.2009	26.02.2021	1 384 344	%	110.450	100.420	26.02.	2.875	143.75	N
	GBP	1'000.00	01.12.1998	01.12.2021	975 786	%	116.580	99.596	01.12.	5.500	73.023	N
	EUR	50'000.00	02.06.2006	02.06.2022	2 572 653	%	119.060	99.503	02.06.	4.375	2'377.26	N
	CHF	5'000.00	12.11.2010	12.11.2026	11 888 673	%	116.350	101.331	12.11.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	10.03.2011	10.03.2031	12 485 532	%	127.150	101.181	10.03.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	30.06.2006	30.06.2032	2 582 694	%	137.500	100.715	30.06.	3.250	162.50	N
	CHF	5'000.00	24.11.2010	24.11.2034	11 957 772	%	120.270	100.912	24.11.	2.000	100.00	N
	CHF	5'000.00	11.03.2011	11.03.2037	12 506 777	%	136.200	102.173	11.03.	2.625	131.25	N
Société Générale, Paris, Frankreich												
Fixed to Floating Rate Notes 2007-Without Fixed Maturity Variable Rate Reg-S Subord. 19.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	50'000.00	19.12.2007	04.01.2018	3 627 776		-	100.000	19.12.	6.999	4'081.29	N
	CHF	5'000.00	19.06.2013	19.06.2018	21 293 722	%	100.620	100.354	19.06.	0.875	43.750	N
	GBP	1'000.00	31.01.2011	20.12.2018	12 407 449	%	103.370	99.302	20.12.	5.000	66.003	N
	USD	1'000.00	12.01.2017	12.01.2022	35 277 111	%	100.450	100.000	12.07.	3.250	15.667	N
	CHF	5'000.00	22.02.2017	22.02.2022	35 394 540	%	100.550	100.012		0.400	0.000	N
	EUR	100'000.00	13.07.2012	13.07.2022	18 972 289	%	117.600	99.274	13.07.	4.250	4'690.08	N
	CHF	5'000.00	19.09.2012	19.09.2022	19 327 073	%	110.750	100.192	19.09.	2.375	118.75	N
	AUD	2'000.00	13.10.2016	13.10.2026	34 216 365	%	102.210	100.000	13.10.	4.875	74.946	N
SoftBank Corp., Tokyo, Japan												
	EUR	1'000.00	19.09.2017	19.09.2025	38 308 836	%	98.390	100.000		3.125	0.000	N
Solvay SA, Bruxelles, Belgien												
	EUR	250'000.00	27.06.2003	27.06.2018	1 624 773	%	102.190	99.153	27.06.	4.625	12'592.14	N
Southern Gas Networks Plc, Horley, Grossbritannien												
	GBP	1'000.00	02.11.2009	02.11.2018	10 683 393	%	103.410	99.689	02.11.	5.125	66.811	N
	GBP	1'000.00	05.10.2011	05.10.2023	13 994 184	%	116.390	99.435	05.10.	4.875	62.638	N
Southern Water Services (Finance) Ltd, George Town, Kaimaninseln												
	GBP	1'000.00	05.03.2009	31.03.2019	4 388 253	%	106.360	99.428	31.03.	6.125	76.664	N
Space-Communication Ltd, Ramat Gan, Israel												
	ILS	1.00	29.03.2015	30.06.2022	27 708 877	%	105.730	100.000	30.06. 31.12.	4.600	0.00625 0.0065	N
Spar Oesterreichischer Warenhandel AG, Salzburg, Österreich												
	EUR	1'000.00	21.09.2012	21.09.2017	19 493 561		-	101.400	21.09.	3.500	40.603	N
Sparebank 1 Boligkreditt, Stavanger, Norwegen												
Emissionsdisagio von 0.694% 17.3.2017 Em.preis: 99.306%	EUR	1'000.00	17.03.2010	17.03.2017	11 118 628		-	99.306	17.03. 17.03.	3.250	34.838 7.439	N
SpareBank 1 Nord-Norge, Tromso, Norwegen	EUR	1'000.00	28.08.2012	28.02.2018	19 327 033	%	100.250	99.580	28.02.	1.250	13.338	N
	CHF	5'000.00	02.12.2014	02.12.2020	26 049 628	%	103.100	100.477	02.12.	0.875	43.750	N
SpareBank 1 SMN, Trondheim, Norwegen	CHF	5'000.00	16.03.2016	16.09.2022	31 642 326	%	100.700	100.056	16.09.	0.300	15.000	N
	CHF	5'000.00	05.04.2016	05.04.2023	31 840 776	%	100.700	100.086	05.04.	0.350	17.500	N
Sparebank 1 SR-Bank ASA, Stavanger, Norwegen												
	CHF	5'000.00	30.05.2013	30.11.2018	21 337 329	%	101.420	100.116	30.11.	0.875	43.750	N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Spark Finance Ltd, Auckland, Neuseeland												
	GBP	1'000.00	06.04.2005	06.04.2020	2 107 559	%	107.720	99.966	06.04.	5.750	72.148	N
SRLEV NV, Alkmaar, Niederlande												
	CHF	5'000.00	19.07.2011		13 024 958	%	102.700	101.000	19.12.	7.000	266.90	N
SSE plc, Perth, Grossbritannien												
	EUR	1'000.00	18.09.2012	13.10.2017	19 493 289		-	99.995	02.10.	5.625	64.262	N
Emissionsdisagio von 0.005% 2.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung									02.10.		0.05712	
	GBP	1'000.00	30.09.2009	01.10.2018	10 586 534	%	103.000	99.354	01.10.	5.000	64.610	N
Stada Arzneimittel AG, Bad Vilbel, Deutschland												
	EUR	1'000.00	05.06.2013	05.06.2018	21 532 359	%	100.310	99.417	05.06.	2.250	24.421	N
	EUR	1'000.00	08.04.2015	08.04.2022	27 774 263	%	101.520	99.407	08.04.	1.750	18.697	N
Stadt Oslo, Norwegen												
	NOK	1'000'000.00	15.05.2009	15.05.2017	10 204 766		-	100.000	15.05.	5.000	2'916.95	N
Standard Chartered Bank, London, Grossbritannien												
	GBP	50'000.00	02.04.2008	03.04.2018	3 913 448	%	101.000	99.615	03.04.	7.750	4'850.27	N
Standard Chartered PLC, London, Grossbritannien												
	EUR	1'000.00	23.11.2012	23.11.2022	20 083 998	%	112.060	99.366	23.11.	3.625	42.149	N
Standard Oil Company (The), Cleveland, USA												
	CHF	5'000.00	15.05.1986		898 297	%	45.100	100.000	15.05.	VAR.	34.084	N
Stanley Black & Decker Inc, New Britain, USA												
	USD	1'000.00	22.11.2011	01.12.2021	14 356 996	%	103.100	99.898	01.06.	3.400	16.480	N
									01.12.		16.730	
Statkraft AS, Oslo, Norwegen												
	EUR	1'000.00	22.03.2007	22.09.2017	3 003 863		-	99.724	22.09.	4.625	53.633	N
Emissionsdisagio von 0.276% 22.9.2017 Em.preis: 99.724%									22.09.		3.200	
	EUR	1'000.00	02.04.2009	02.04.2019	10 075 563	%	108.160	99.530	02.04.	6.625	70.788	N
	EUR	1'000.00	28.11.2012	28.11.2022	20 083 990	%	109.610	99.581	28.11.	2.500	29.200	N
Statnett SF, Oslo, Norwegen												
	CHF	5'000.00	15.12.2006	15.12.2017	2 786 624		-	101.130	15.12.	2.625	131.25	N
	CHF	5'000.00	08.06.2011	08.02.2021	12 973 491	%	107.550	100.894	08.02.	2.375	118.75	N
Statoil ASA, Stavanger, Norwegen												
	USD	1'000.00	17.08.2010	17.08.2017	11 629 839		-	99.782	17.02.	3.125	15.641	N
									17.08.		15.064	
Emissionsdisagio von 0.218% 17.8.2017 Em.preis: 99.782%									17.08.		2.101	
	USD	1'000.00	21.11.2012	17.01.2018	20 043 832	%	99.320	99.885	17.01.	1.200	6.016	N
									17.07.		5.777	
	USD	1'000.00	15.05.2013	15.05.2018	21 372 830	%	99.710	99.782	15.05.	1.150	5.730	N
									15.11.		5.690	
	USD	1'000.00	23.04.2009	15.04.2019	10 127 521		-	99.809	15.04.	5.250	26.293	N
									15.10.		25.598	
									14.12.		8.519	
Emissionsdisagio von 0.191%									14.12.		1.891	
Rückzahlungsagio von 4.081% 14.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung									14.12.		40.406	
	USD	1'000.00	23.11.2011	23.01.2022	14 345 153	%	101.840	99.830	23.01.	3.150	15.729	N
									23.07.		14.899	
	USD	1'000.00	21.11.2012	17.01.2023	20 043 836	%	99.080	99.676	17.01.	2.450	12.283	N
									17.07.		11.796	
	USD	1'000.00	15.05.2013	15.01.2024	21 372 800	%	99.300	99.802	15.01.	2.650	13.395	N
									15.07.		12.759	
Ste des Autoroutes Paris-Rhin-Rhone anc.Autoroutes Paris-Lyon, Saint-Apollinaire, Frankreich												
	EUR	100'000.00	06.11.2015	15.01.2024	30 270 357	%	104.540	99.445	15.01.	1.500	1'612.63	N
Steinhoff Europe AG, Brunn am Gebirge, Österreich												
	EUR	100'000.00	24.07.2017	24.01.2025	37 561 430	%	43.000	99.444		1.875	0.000	N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Student Loan Marketing Association Sallie Mae, USA												
	USD	5'000.00	03.10.1984	03.10.2022	898 476	%	88.050	3.510		0.000	0.000	Y
StudierendeGesellschaft Witten/Herdecke e.V., Witten, Deutschland												
	EUR	1'000.00	02.12.2014	02.12.2024	26 054 950	%	101.000	100.000	02.12.	3.600	42.010	N
Suedzucker International Finance BV, Oud-Beijerland, Niederlande												
Fixed to Floating Rate Notes 2005-Without Fixed Maturity VRN Reg-S Subord.	EUR	1'000.00	30.06.2005		2 191 417	%	100.270	98.669	31.03.	2.771	7.525	N
									30.06.		7.647	
									29.09.		8.005	
									29.12.		8.196	
	EUR	1'000.00	29.03.2011	29.03.2018	12 748 342	%	101.010	99.541	29.03.	4.125	44.213	N
Suez SA, Paris, Frankreich												
	EUR	100'000.00	17.05.2011	17.05.2021	13 028 045	%	113.130	100.000	17.05.	4.078	4'450.11	N
	EUR	100'000.00	10.09.2015	10.09.2025	29 585 367	%	106.730	98.987	10.09.	1.750	1'996.48	N
Sumitomo Mitsui Banking Corporation, Tokyo, Japan												
	AUD	2'000.00	16.09.2014	16.09.2019	25 370 895	%	101.820	99.510	16.09.	3.875	59.332	N
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc., Tokyo, Japan												
	AUD	1'000.00	07.09.2017	07.03.2023	38 145 385	%	100.600	100.000		3.604	0.000	N
Sunrise Communications Holding SA, Luxemburg												
	CHF	1'000.00	17.02.2015	31.03.2022	27 128 811	%	99.120	100.000	30.03.	2.125	10.625	N
									30.09.		10.625	
Svenska Handelsbanken AB, Stockholm, Schweden												
Additional Tier 1 Notes 2015-Without Fixed Maturity VRN Jr Reg-S Series 325 Subord.	USD	1'000.00	25.02.2015		27 212 752	%	101.740	100.000	01.03.	5.250	52.967	N
	CHF	5'000.00	11.03.2014	11.12.2018	23 702 725	%	101.230	100.544	11.12.	0.625	31.250	N
	AUD	10'000.00	10.04.2014	10.04.2019	24 139 367	%	102.290	99.338	10.04.	4.500	169.62	N
									10.10.		171.28	
	CHF	5'000.00	25.09.2013	20.12.2019	22 235 942	%	103.050	100.440	20.12.	1.250	62.500	N
	CHF	5'000.00	05.10.2012	05.10.2022	19 495 898	%	106.500	100.561	05.10.	1.375	68.750	N
Swedbank Hypotek AB, Stockholm, Schweden												
	CHF	5'000.00	08.12.2010	08.12.2017	11 853 277		-	100.730	08.12.	1.625	81.250	N
	CHF	5'000.00	21.06.2011	21.06.2021	13 122 063	%	107.400	100.017	21.06.	2.250	112.50	N
	CHF	5'000.00	03.06.2011	03.06.2022	12 991 807	%	111.600	100.000	03.06.	2.500	125.00	N
Swedish Covered Bond Corporation, Stockholm, Schweden												
	CHF	5'000.00	15.02.2010	15.02.2017	10 911 757		-	100.338	15.02.	2.125	106.25	N
Swedish Match AB, Stockholm, Schweden												
	EUR	1'000.00	24.11.2010	24.11.2017	12 043 965		-	99.687	24.11.	3.875	45.281	N
Emissionsdisagio von 0.313% 24.11.2017 Em.preis: 99.687%									24.11.		3.657	
	CHF	5'000.00	26.06.2013	26.06.2023	21 527 844	%	107.650	100.211	26.06.	2.125	106.25	N
Sydney Airport Finance Co Pty Ltd, Sydney NSW, Australien												
	EUR	1'000.00	23.04.2014	23.04.2024	24 229 904	%	111.100	99.845	23.04.	2.750	29.737	N
Syngenta Finance N.V., Enkhuizen, Niederlande												
	EUR	100'000.00	02.04.2014	02.11.2021	24 064 556	%	102.300	99.843	02.11.	1.875	2'183.62	N
	USD	1'000.00	28.03.2012	28.03.2022	18 256 079	%	96.640	99.838	28.03.	3.125	15.368	N
									28.09.		15.178	

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
TAG Immobilien AG, Hamburg, Deutschland												
	EUR	1'000.00	07.08.2013	07.08.2018	22 014 859	%	102.800	100.000	07.02. 07.08.	5.125	27.317 29.391	N
Takeda Pharmaceutical Company Limited, Osaka, Japan												
	USD	1'000.00	17.07.2012	17.03.2017	19 009 984		-	100.000	17.03.	1.625	8.108	N
TAKKO Luxembourg 2 S.C.A., Luxemburg												
	EUR	1'000.00	05.04.2013	15.04.2019	21 025 533		-	99.437	15.04. 15.10. 09.11. 09.11. 09.11.	9.875	52.739 56.803 7.639 6.533 28.651	N
Emissionsdisagio von 0.563% Rückzahlungsagio von 2.469% 9.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Tanner Servicios Financieros SA, Santiago, Chile												
	CHF	5'000.00	15.11.2016	15.11.2019	34 172 594	%	102.950	100.000	15.11.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	10.11.2017	10.11.2020	38 412 513	%	101.300	100.000		1.375	0.000	N
Telecom Italia Capital SA, Luxemburg												
	USD	1'000.00	04.06.2008	04.06.2018	4 285 417	%	101.800	100.000	04.06. 04.12.	6.999	33.755 34.461	N
	USD	1'000.00	18.06.2009	18.06.2019	10 280 599	%	106.140	100.000	18.06. 18.12.	7.175	34.938 35.355	N
	USD	1'000.00	15.05.2004	15.11.2033	1 946 137	%	115.990	99.558	15.05. 15.11.	6.375	31.767 31.546	N
	USD	1'000.00	04.06.2008	04.06.2038	4 284 250	%	128.590	100.000	04.06. 04.12.	7.721	37.237 38.016	N
Telecom Italia Finance S.A., Luxemburg												
	EUR	1'000.00	24.01.2003	24.01.2033	1 542 495	%	153.370	98.239	24.01.	7.750	83.498	N
Telecom Italia S.p.A., Mailand, Italien												
	GBP	50'000.00	26.05.2009	15.12.2017	10 207 899		-	99.608	15.12. 15.12.	7.375	4'870.82 258.89	N
Emissionsdisagio von 0.392% 15.12.2017 Em.preis: 99.608%												
	EUR	1'000.00	25.05.2011	25.05.2018	13 065 387	%	101.880	99.889	25.05.	4.750	51.782	N
	EUR	100'000.00	29.01.2004	29.01.2019	1 769 813	%	105.700	99.070	29.01.	5.375	5'745.71	N
	GBP	50'000.00	24.06.2004	24.06.2019	1 885 761	%	107.470	98.850	24.06.	6.375	3'940.37	N
	GBP	50'000.00	19.05.2006	19.05.2023	2 563 633	%	117.070	99.622	19.05.	5.875	3'728.30	N
3.625 % Euro Medium-Term Notes 2016-19.1.24 Reg-S Series 36	EUR	1'000.00	20.01.2016	19.01.2024	31 118 455	%	111.620	99.632	19.01.	3.625	38.876	N
3 % Euro Medium Term Notes 2016-30.09.25 Series 38 Reg S	EUR	1'000.00	30.09.2016	30.09.2025	34 090 545	%	107.240	100.000	30.09.	3.000	34.273	N
Telefonica Chile SA, Santiago, Chile												
	USD	1'000.00	12.10.2012	12.10.2022	19 755 316	%	102.310	99.901	12.04. 12.10.	3.875	19.469 18.913	N
Telefonica Emisiones S.A.U, Madrid, Spanien												
	EUR	100'000.00	07.02.2011	07.02.2017	12 397 867		-	100.000	07.02.	4.750	5'077.61	N
	USD	1'000.00	02.07.2007	03.07.2017	3 215 800		-	100.000	03.01. 03.07.	6.221	32.005 29.957	N
	EUR	100'000.00	19.09.2012	05.09.2017	19 441 056		-	100.000	05.09.	5.811	6'623.08	N
	EUR	50'000.00	16.09.2010	18.09.2017	11 722 590		-	100.000	18.09.	3.661	2'101.32	N
	GBP	1'000.00	02.02.2006	02.02.2018	2 416 554	%	100.350	99.730	02.02.	5.375	66.816	N
	EUR	100'000.00	21.02.2012	21.02.2018	14 961 416	%	100.540	100.000	21.02.	4.797	5'116.78	N
	USD	1'000.00	29.04.2013	27.04.2018	21 212 910	%	100.350	100.000	27.04. 27.10.	3.192	15.874 15.950	N
	CHF	5'000.00	14.12.2012	14.12.2018	19 784 156	%	103.000	100.000	14.12.	2.718	135.90	N
	EUR	100'000.00	29.05.2013	29.05.2019	21 418 216	%	103.880	100.000	29.05.	2.736	2'985.38	N
	USD	1'000.00	06.07.2009	15.07.2019	10 295 953	%	104.920	100.000	15.01. 15.07.	5.877	29.707 28.297	N
	EUR	50'000.00	10.11.2009	11.11.2019	10 691 709	%	108.660	100.000	11.11.	4.693	2'724.75	N
	EUR	100'000.00	19.10.2012	20.01.2020	19 763 115	%	109.440	100.000	20.01.	4.710	5'070.03	N
	GBP	100'000.00	12.03.2012	12.03.2020	18 084 108	%	108.350	100.000	12.03.	5.597	6'893.64	N
	USD	1'000.00	26.04.2010	27.04.2020	11 223 328	%	104.760	100.000	27.04. 27.10.	5.134	25.532 25.654	N
	CHF	5'000.00	23.10.2013	23.10.2020	22 241 830	%	107.050	100.000	23.10.	2.595	129.75	N
	USD	1'000.00	16.02.2011	16.02.2021	12 473 554	%	107.960	100.000	16.02. 16.08.	5.462	27.272 26.634	N
	EUR	100'000.00	27.03.2013	26.03.2021	20 968 887	%	112.020	100.000	26.03.	3.961	4'239.65	N
	CHF	5'000.00	14.12.2012	14.12.2022	20 025 278	%	115.700	100.000	14.12.	3.450	172.50	N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	USD	1'000.00	29.04.2013	27.04.2023	21 212 914	%	107.980	100.000	27.04. 27.10.	4.570	22.728 22.836	N
Telefonica Europe BV, Amsterdam, Niederlande												
Notes 2016-open end Guaranteed Reg S Fixed/Variable Rate	EUR	100'000.00	15.09.2016		33 913 768	%	105.200	100.000	15.03.	3.750	1'992.82	N
Telekom Finanzmanagement GmbH, Wien, Österreich												
	EUR	1'000.00	27.01.2005	27.01.2017	2 047 517		-	98.829	27.01. 27.01.	4.250	45.537 12.512	N
Emissionsdisagio von 1.171% 27.1.2017 Em.preis: 98.829%												
	EUR	1'000.00	03.12.2013	03.12.2021	22 987 626	%	110.880	99.367	03.12.	3.125	36.467	N
Telenor ASA, Fornebu, Norwegen												
	USD	1'000.00	22.05.2013	22.05.2018	21 412 342	%	99.900	99.787	22.05.	1.750	17.022	N
Telstra Corporation Limited, Melbourne, Australien												
	AUD	10'000.00	13.11.2013	13.11.2018	22 837 777	%	101.680	99.514	13.05. 13.11.	4.500	165.02 172.46	N
	CHF	5'000.00	14.12.2011	14.12.2018	14 282 140	%	102.160	100.341	14.12.	1.750	87.500	N
	EUR	1'000.00	26.10.2010	15.03.2021	11 914 538	%	111.070	99.032	15.03.	3.625	38.847	N
	EUR	1'000.00	16.11.2011	16.05.2022	14 304 654	%	114.540	98.771	16.05.	3.750	41.030	N
	EUR	1'000.00	21.03.2012	21.09.2022	18 192 255	%	114.190	99.617	21.09.	3.500	40.603	N
Temasek Financial (I) Ltd, Singapur												
	GBP	1'000.00	26.07.2010	26.07.2040	11 555 095	%	148.150	99.550	26.07.	5.125	64.159	N
Tennessee Valley Authority, Knoxville, USA												
	USD	1'000.00	03.11.1995	01.11.2025	73 366	%	128.910	99.401	01.05. 01.11.	6.750	33.545 33.795	N
TenneT Holding B.V., Arnhem, Niederlande												
	EUR	1'000.00	21.02.2011	21.02.2018	12 507 373	%	100.540	99.795	21.02.	3.875	41.333	N
TEREOS FINANCE GROUPE I, Origny-Sainte-Benoite, Frankreich												
	EUR	100'000.00	04.03.2013	04.03.2020	20 830 602	%	103.200	99.260	04.03.	4.250	4'554.93	N
Terna S.p.A. - Rete Elettrica Nazionale, Rom, Italien												
	EUR	1'000.00	17.02.2012	17.02.2017	14 999 548		-	99.809	17.02. 17.02.	4.125	44.012 2.032	N
Emissionsdisagio von 0.191% 17.2.2017 Em.preis: 99.809%												
	EUR	1'000.00	28.10.2004	28.10.2024	1 975 647	%	128.970	99.624	28.10.	4.900	56.803	N
Tesco Personal Finance PLC, Edinburgh, Grossbritannien												
	GBP	100.00	24.02.2011	24.08.2018	12 477 470	%	101.120	100.000	24.02. 24.08.	5.200	3.296 3.183	N
Tesco PLC, Welwyn Garden City, Grossbritannien												
	EUR	1'000.00	02.11.2011	02.11.2018	14 219 472	%	102.540	99.510	02.11.	3.375	39.305	N
	GBP	1'000.00	13.12.2002	13.12.2019	1 525 116	%	108.240	99.073	13.12.	5.500	72.688	N
	GBP	1'000.00	24.02.2009	24.02.2022	3 715 198	%	114.330	99.629	24.02.	6.125	77.240	N
	EUR	1'000.00	10.04.2007	10.04.2047	3 035 261	%	122.620	98.418	10.04.	5.125	54.758	N
19.6.2017 Rückkauf ausstehender Titel												
Teva Pharmaceutical Finance Co BV, Willemstad, Curaçao												
	USD	1'000.00	18.12.2012	18.12.2022	20 275 006	%	88.930	99.802	18.06. 18.12.	2.950	14.364 14.536	N
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, Amsterdam, Niederlande												
	EUR	1'000.00	25.07.2016	25.07.2020	33 377 323		n.v.	99.644	25.07.	0.375	4.149	N
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III B.V, Amsterdam, Netherlands, Niederlande												
	USD	1'000.00	21.07.2016	19.07.2019	33 338 072	%	96.900	99.991	19.01. 19.07.	1.700	8.495 8.111	N
	USD	1'000.00	21.07.2016	21.07.2023	33 338 081	%	86.650	99.666	21.01. 21.07.	2.800	13.981 13.264	N
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands IV BV, Amsterdam, Niederlande												
	CHF	5'000.00	28.07.2016	27.07.2018	33 382 747	%	99.430	100.000	27.07.	0.125	6.232	N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	CHF	5'000.00	28.07.2016	28.07.2022	33 382 749	%	90.500	100.221	28.07.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	28.07.2016	28.07.2025	33 382 750	%	86.450	100.257	28.07.	1.000	50.000	N
Teva Pharmaceutical Finance V B.V., Curacao, Curaçao												
	CHF	5'000.00	25.04.2012	25.10.2018	18 336 512	%	100.230	100.561	25.10.	1.500	75.000	N
Teva Pharmaceuticals Finance IV BV, Curaçao												
	EUR	1'000.00	04.04.2012	15.04.2019	18 330 008	%	101.240	99.648	15.04.	2.875	30.709	N
Teva Pharmaceuticals Finance IV LLC, USA												
	USD	1'000.00	18.12.2012	18.03.2020	20 275 333	%	96.600	99.955	18.03. 18.09.	2.250	11.212 10.802	N
Thales, Neuilly-sur-Seine, Frankreich												
	EUR	100'000.00	20.03.2013	20.03.2018	20 955 579	%	100.160	99.824	20.03.	1.625	1'741.59	N
	EUR	100'000.00	20.03.2013	19.03.2021	20 955 602	%	106.410	99.322	19.03.	2.250	2'411.43	N
Thames Water (Kemble) Finance PLC, Reading, Grossbritannien												
	GBP	1'000.00	07.04.2011	01.04.2019	12 821 107	%	107.980	100.000	01.04. 01.10.	7.750	48.502 50.073	N
The Export Import Bank of Korea, Seoul, Korea (Republik)												
	CHF	5'000.00	03.03.2014	03.03.2017	23 633 109		-	100.000	03.03.	VAR.	0.000	N
Emissionsdisagio von 0.313% 15.12.2017 Em.preis: 99.687%	NZD	2'000.00	05.06.2014	15.12.2017	24 523 022		-	99.687	15.12. 15.12.	4.875	67.769 4.351	N
	CNY	1'000'000.00	03.03.2015	03.03.2018	27 129 644	%	100.050	100.000	03.03.	4.400	6'445.42	N
	NOK	1'000.00	22.05.2013	22.05.2018	21 436 518	%	100.520	99.750	22.05.	3.000	3.499	N
	CNY	1'000.00	27.01.2014	27.01.2019	23 442 981	%	99.080	100.000	27.01. 27.07.	3.625	2.651 2.569	N
	NZD	2'000.00	27.08.2014	27.08.2019	25 259 870	%	102.840	99.561	27.08.	5.125	70.966	N
	CHF	5'000.00	03.03.2014	03.09.2019	23 633 112	%	102.000	100.266	03.09.	1.125	56.250	N
	AUD	2'000.00	12.09.2013	12.09.2019	22 305 943	%	103.810	100.906	12.09.	5.375	82.889	N
	NZD	2'000.00	15.10.2014	15.10.2019	25 667 713	%	102.920	99.940	15.10.	5.125	71.778	N
	AUD	2'000.00	25.02.2014	25.02.2020	23 709 584	%	103.830	101.698	25.02.	5.125	79.465	N
	AUD	1'000.00	21.11.2014	21.05.2020	26 104 446	%	102.300	99.515	21.05. 21.11.	4.250	15.345 16.115	N
	NZD	1'000.00	09.03.2017	09.03.2022	35 853 846	%	102.000	99.529	09.09.	4.000	13.927	N
	CHF	5'000.00	18.07.2017	18.07.2025	37 063 463	%	98.950	100.000		0.170	0.000	N
The Kraft Heinz Company, Pittsburgh, USA												
Emissionsdisagio von 0.183% 5.6.2017 Em.preis: 99.817%	USD	1'000.00	04.06.2012	05.06.2017	18 737 792		-	99.817	05.06. 05.06.	2.250	10.851 1.765	N
	USD	1'000.00	04.06.2012	06.06.2022	18 738 192	%	102.030	99.100	06.06. 06.12.	3.500	16.863 17.321	N
	USD	1'000.00	06.12.2012	06.06.2022	19 803 045	%	102.190	99.100	06.06. 06.12.	3.500	16.863 17.321	N
The Royal Bank of Scotland PLC, Edinburgh, Grossbritannien												
Emissionsdisagio von 0.666% 20.1.2017 Em.preis: 99.334%	EUR	1'000.00	20.01.2010	20.01.2017	10 920 631		-	99.334	20.01. 20.01.	4.875	52.476 7.149	N
	AUD	1'000.00	10.05.2013	10.05.2017	18 244 783		-	100.000	10.02. 10.05.	VAR.	5.781 5.591	N
Emissionsdisagio von 0.088% 17.5.2017 Em.preis: 99.912%	GBP	1'000.00	17.05.2010	17.05.2017	11 226 551		-	99.912	17.05. 17.05.	6.000	76.200 1.117	N
	GBP	1'000.00	15.09.2008	17.09.2018	4 569 761	%	103.780	99.387	17.03. 17.09.	6.625	40.562 43.401	N
	EUR	1'000.00	11.01.2010	11.01.2020	10 722 534	%	115.920	100.000	11.01. 11.04. 11.07. 11.10.	VAR.	22.739 22.248 23.285 24.523	N
Emissionsdisagio von 0.242% 16.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	16.03.2012	16.03.2022	18 000 609		-	99.758	16.03. 16.03.	9.375	93.750 2.420	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
The Servicemaster Company, Memphis, USA												
	USD	1'000.00	02.03.1998	01.03.2018	1 231 231	%	100.850	99.768	01.03. 01.09.	7.100	35.816 34.173	N
Thermo Fisher Scientific Inc., Waltham, USA												
	USD	1'000.00	16.08.2011	15.08.2021	13 585 619	%	102.610	99.809	15.02. 15.08.	3.600	18.151 17.511	N
	EUR	1'000.00	12.09.2016	12.09.2024	33 899 922	%	97.650	99.122	12.09.	0.750	8.603	N
	EUR	1'000.00	12.09.2016	12.09.2028	33 899 926	%	96.390	99.748	12.09.	1.375	15.773	N
Thomas Cook Group PLC, London, Grossbritannien												
	EUR	1'000.00	08.12.2016	15.06.2022	34 875 693	%	107.800	100.000	15.06. 15.12.	6.250	35.288 36.467	N
thyssenkrupp AG, Duisburg/Essen, Deutschland												
Emissionsdisagio von 0.247% 28.2.2017 Em.preis: 99.753%	EUR	1'000.00	28.02.2012	28.02.2017	18 051 280		-	99.753	28.02. 28.02.	4.375	46.684 2.628	N
	EUR	1'000.00	25.02.2013	27.08.2018	20 749 018	%	102.590	99.681	27.08.	4.000	45.672	N
	EUR	1'000.00	25.02.2014	25.10.2019	23 783 701	%	104.160	99.201	25.10.	3.125	36.539	N
	EUR	1'000.00	25.02.2015	25.11.2020	27 212 094	%	103.520	99.328	25.11.	1.750	20.459	N
	EUR	1'000.00	25.02.2015	25.02.2025	27 212 092	%	107.990	98.818	25.02.	2.500	26.752	N
Tingyi (Cayman Islands) Holding Corp., George Town, Kaimaninseln												
	CNY	10'000.00	06.08.2015	06.08.2018	29 124 213	%	100.200	99.656	06.08.	4.375	63.323	N
T-Mobile USA Inc., Bellevue, USA												
4.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	21.08.2013	01.09.2018	22 148 632		-	100.000	04.03. 04.03.	5.250	0.44243 13.278	N
28.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	16.10.2013	28.04.2019	22 561 160		-	102.000	28.01. 28.04.	6.464	32.227 16.086	N
Tokyo Electric Power Co. Holdings, Inc, Tokyo, Japan												
	CHF	5'000.00	24.03.2010	24.03.2017	11 062 372		-	101.055	24.03.	2.125	106.25	N
Toronto-Dominion Bank (The), Toronto, Kanada												
	NZD	2'000.00	03.04.2013	03.04.2018	21 023 390	%	99.940	99.710	03.04.	4.250	59.671	N
Total Capital Canada Ltd, Calgary, Kanada												
	USD	1'000.00	17.01.2013	15.01.2018	20 445 279	%	99.880	99.904	15.01. 15.07.	1.450	7.329 6.981	N
	AUD	2'000.00	06.03.2013	06.09.2018	20 829 631	%	101.050	101.600	06.09.	4.000	60.969	N
	AUD	2'000.00	23.09.2014	23.09.2019	25 484 909	%	102.060	101.314	23.09.	3.750	57.736	N
	CAD	2'000.00	11.09.2014	31.01.2020	25 399 391	%	99.580	99.509	31.01.	2.125	32.248	N
	USD	1'000.00	17.01.2013	15.07.2023	20 445 291	%	100.540	99.819	15.01. 15.07.	2.750	13.901 13.241	N
Total Capital International SA, Courbevoie, Frankreich												
	AUD	2'000.00	25.01.2012	25.01.2017	14 761 861		-	101.123	25.01.	4.875	73.802	N
Emissionsdisagio von 0.436% 17.2.2017 Em.preis: 99.564%	USD	1'000.00	17.02.2012	17.02.2017	18 005 018		-	99.564	17.02. 17.02.	1.500	7.507 4.364	N
	AUD	2'000.00	26.06.2012	26.06.2017	18 870 609		-	101.134	26.06.	4.125	60.751	N
Emissionsdisagio von 0.187% 28.6.2017 Em.preis: 99.813%	USD	1'000.00	28.06.2012	28.06.2017	18 894 750		-	99.813	28.06. 28.06.	1.550	7.441 1.795	N
	NOK	10'000.00	11.09.2012	11.09.2017	19 433 294		-	100.694	11.09.	2.250	27.298	N
	AUD	2'000.00	05.12.2012	05.12.2017	20 120 034		-	101.318	05.12.	3.875	58.244	N
	NOK	10'000.00	14.06.2013	14.06.2018	21 589 394	%	100.610	101.532	14.06.	2.500	28.863	N
	CAD	2'000.00	27.11.2013	27.11.2018	22 932 495	%	100.270	101.188	27.11.	2.375	36.619	N
	AUD	2'000.00	04.03.2014	04.03.2019	23 792 177	%	101.850	101.208	04.03.	4.125	63.310	N
	NZD	2'000.00	01.07.2014	01.07.2019	24 771 903	%	103.530	101.409	01.07.	5.000	70.133	N
	NZD	2'000.00	06.10.2014	06.01.2020	25 569 021	%	103.830	101.101	06.01.	4.750	67.474	N
	NZD	2'000.00	02.09.2014	02.09.2020	25 259 858	%	105.290	101.388	02.09.	5.000	68.627	N
	GBP	1'000.00	19.11.2014	17.12.2020	26 074 830	%	103.540	99.632	17.12.	2.250	29.709	N
	AUD	2'000.00	26.11.2014	26.11.2021	26 125 235	%	104.990	99.491	26.05. 26.11.	4.250	30.575 32.026	N
	USD	1'000.00	17.02.2012	17.02.2022	18 005 003	%	101.230	99.948	17.02. 17.08.	2.875	14.389 13.859	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	USD	1'000.00	25.09.2012	25.01.2023	19 607 246	%	100.100	99.787	25.01. 25.07.	2.700	13.488 12.808	N
	EUR	100'000.00	18.09.2012	15.03.2023	19 500 788	%	108.880	98.840	15.03.	2.125	2'277.25	N
	CHF	5'000.00	29.08.2014	29.08.2024	24 790 289	%	105.750	100.584	29.08.	1.000	50.000	N
	CHF	5'000.00	01.06.2015	01.06.2027	28 201 898	%	102.550	100.233	01.06.	0.500	25.000	N
Total Capital SA, Courbevoie, Frankreich												
	EUR	1'000.00	06.06.2007	06.06.2017	3 131 196		-	100.133	06.06.	4.700	51.020	N
	GBP	1'000.00	02.06.2009	08.12.2017	10 204 456		-	100.255	08.12.	4.250	56.531	N
	CHF	5'000.00	28.06.2006	28.06.2018	2 573 931	%	101.890	101.020	28.06.	3.125	156.25	N
	CNY	1'000'000.00	24.09.2013	24.09.2018	22 358 954	%	99.480	100.000	24.03. 24.09.	3.750	2'675.93 2'767.24	N
	GBP	1'000.00	14.01.2011	14.12.2018	12 292 256	%	102.960	99.938	14.12.	3.875	51.503	N
	EUR	1'000.00	28.01.2009	28.01.2019	4 991 874	%	104.990	99.265	28.01.	4.875	52.111	N
	USD	1'000.00	24.06.2010	24.06.2020	11 453 402	%	105.180	99.601	24.06. 24.12.	4.450	21.591 22.018	N
	USD	1'000.00	28.01.2011	28.01.2021	12 390 123	%	105.210	99.248	28.01. 28.07.	4.125	20.566 19.979	N
	USD	1'000.00	15.12.2009	15.12.2021	10 817 539	%	106.630	98.898	15.06. 15.12.	4.250	20.715 21.076	N
	EUR	1'000.00	16.09.2010	16.09.2022	11 743 591	%	113.140	99.311	16.09.	3.125	35.873	N
	EUR	1'000.00	26.03.2009	26.03.2024	10 043 183	%	128.010	99.538	26.03.	5.125	54.855	N
Total S.A., Courbevoie, Frankreich												
Euro Medium Term Notes 2016-open end Series 111 Def Cpn Reg S Fixed/Variable Rate	EUR	1'000.00	18.05.2016		32 582 442	%	111.850	100.000	18.05.	3.875	42.185	N
Notes 2016-open end Reg S Fixed/Variable Rate	EUR	1'000.00	06.10.2016		34 159 187	%	109.490	100.000	06.10.	3.369	38.659	N
Toyota Finance Australia Ltd, St Leonards, Australien												
	AUD	1'000.00	15.05.2014	15.05.2019	24 440 967	%	102.550	100.000	15.05. 15.11.	4.250	15.586 16.077	N
	AUD	2'000.00	21.02.2017	21.02.2022	35 728 271	%	101.500	99.732		3.250	0.000	N
	AUD	2'000.00	21.11.2017	21.11.2022	39 163 450	%	99.030	99.523		2.875	0.000	N
Toyota Motor Credit Corp, Torrance, USA												
Tranche 857 Emissionsdisagio von 0.165% 12.1.2017 Em.preis: 99.835%	USD	1'000.00	12.01.2012	12.01.2017	14 711 867		-	99.835	12.01. 12.01.	2.050	10.332 1.663	N
Tranche 868 Emissionsdisagio von 0.366% 22.5.2017 Em.preis: 99.634%	USD	1'000.00	22.05.2012	22.05.2017	18 638 512		-	99.634	22.05. 22.05.	1.750	8.511 3.560	N
	AUD	2'000.00	05.07.2012	05.07.2017	18 933 040		-	101.292	05.07.	4.375	64.071	N
Emissionsdisagio von 0.05% 1.8.2017 Em.preis: 99.95%	EUR	1'000.00	01.02.2013	01.08.2017	20 548 943		-	99.950	01.08. 01.08.	1.250	14.255 0.57022	N
Emissionsdisagio von 0.161% 7.12.2017 Em.preis: 99.839%	GBP	1'000.00	25.02.2011	07.12.2017	12 546 301		-	99.839	07.12. 07.12.	4.000	53.296 2.145	N
	USD	1'000.00	19.02.2016	19.02.2019	31 618 384	%	99.800	99.988	19.02. 19.08.	1.700	8.518 8.163	N
	EUR	1'000.00	09.09.2015	09.03.2021	29 577 817	%	102.820	99.911	09.03.	1.000	10.734	N
	AUD	1'000.00	26.07.2016	26.07.2021	33 345 517	%	99.860	99.768	26.07.	2.750	10.363	N
Tranche 858	USD	1'000.00	12.01.2012	12.01.2022	14 711 870	%	102.900	99.629	12.01. 12.07.	3.300	16.633 15.909	N
	EUR	1'000.00	21.01.2015	21.07.2022	26 718 984	%	102.120	99.703	21.07.	0.750	8.283	N
TRAFIGURA BEHEER BV, Amsterdam, Niederlande												
Perpetual Resettable Step-up Subordinated Securities 2013-Without Fixed Maturity Variable Rate Reg-S Subord.	USD	1'000.00	19.04.2013		21 144 967	%	100.980	100.000	19.04. 19.10.	7.625	38.050 37.148	N
Transnet SOC Ltd, Johannesburg, Südafrika												
	ZAR	50'000.00	17.04.1998	18.04.2028	859 598	%	115.380	97.166	18.04.	13.500	507.51	N
	ZAR	500'000.00	30.03.1999	30.03.2029	540 742	%	93.640	68.765	30.03.	10.000	3'880.90	N
Transurban Queensland Finance Pty Ltd, Australien												
	CHF	5'000.00	24.06.2016	23.06.2023	32 722 686	%	102.300	100.568	23.06.	0.625	31.163	N
	CHF	5'000.00	02.11.2016	02.11.2026	34 091 216	%	101.950	100.121	02.11.	0.650	32.500	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF		IUP
Turkiye Garanti Bankasi A.S., Istanbul, Türkei													
	TRY	1'000.00	07.03.2013	07.03.2018	20 847 862	%	98.640	99.487	07.03. 07.09.	7.375	10.153 10.298		N
Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari A.S., Istanbul, Türkei													
	USD	1'000.00	09.05.2013	09.05.2020	21 325 525	%	101.550	99.265	09.05. 09.11.	4.250	21.364 21.212		N
TVO Power Co, Eurajoki, Finnland													
	EUR	1'000.00	02.02.2012	04.02.2019	14 868 929	%	104.490	99.788	04.02.	4.625	49.443		N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF		IUP
UBS AG, Australia Branch, Sydney, Australien													
	AUD	1'000.00	27.08.2014	27.08.2019	25 260 360	%	102.620	99.496	27.02. 27.08.	4.000	15.590 15.060		N
UBS AG, Jersey Branch, St Helier, Jersey													
Emissionsdisagio von 0.055% 7.6.2017 Em.preis: 99.945%	EUR	1'000.00	07.06.2007	07.06.2017	3 144 123		-	99.945	07.06. 07.06.	4.750	51.558 0.59699		N
22.2.2017 Amortisation	USD	1'000.00	22.02.2012	22.02.2022	18 012 982		-	100.000	22.02.	VAR.	73.352		N
UBS AG, London Branch, London, Grossbritannien													
Emissionsdisagio von 0.308% 10.1.2017 Em.preis: 99.692%	EUR	1'000.00	10.01.2012	10.01.2017	14 665 554		-	99.692	10.01. 10.01.	2.250	24.224 3.306		N
	GBP	1'000.00	11.04.2008	11.04.2018	3 947 004	%	101.600	99.843	11.04.	6.625	83.242		N
	EUR	1'000.00	18.04.2008	18.04.2018	3 965 107	%	101.720	99.413	18.04.	6.000	64.104		N
	EUR	1'000.00	30.11.2009	02.12.2019	10 773 069	%	107.980	98.937	02.12.	3.875	45.219		N
	EUR	1'000.00	30.06.2015	30.06.2020	28 727 940	%	102.800	99.768	30.06.	1.125	12.287		N
UBS Group Funding (Switzerland) AG, Jersey	EUR	1'000.00	08.04.2010	08.04.2022	11 190 200	%	116.570	99.364	08.04.	4.000	42.738		N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. i VStG	USD	1'000.00	24.09.2015	24.09.2020	29 792 895	%	100.800	99.829	24.03. 24.09.	2.950	14.620 14.293	(L) (L)	N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. i VStG	USD	1'000.00	05.04.2016	15.04.2021	32 072 214	%	100.540	99.925	15.04. 15.10.	3.000	15.024 14.627	(L) (L)	N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. i VStG	USD	1'000.00	10.08.2016	01.02.2022	33 541 787	%	98.920	99.940	01.02. 01.08.	2.650	12.490 12.795	(L) (L)	N
Tranche 1 Reg S ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. i VStG	CHF	200'000.00	22.02.2016	22.02.2022	31 045 184	%	102.500	100.528	22.02.	0.750	1'500.00	(L)	N
ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. i VStG	USD	1'000.00	24.09.2015	24.09.2025	29 792 896	%	104.900	99.813	24.03. 24.09.	4.125	20.443 19.987	(L) (L)	N
Tranche 2 Reg S ohne Verrechnungssteuer gemäss Art. 5 Abs. 1 Bst. i VStG	CHF	200'000.00	22.02.2016	23.02.2026	31 045 185	%	105.450	100.187	23.02.	1.250	2'506.94	(L)	N
UmweltBank AG, Nürnberg, Deutschland													
15.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	250.00	01.02.2016	27.02.2017	31 097 421		-	100.000	15.02.	2.850	8.018		N
Unibail-Rodamco SE, Paris, Frankreich													
	CHF	5'000.00	20.11.2013	20.11.2023	22 675 229	%	110.100	100.613	20.11.	2.000	100.00		N
UniCredit Bank Austria AG, Wien, Österreich													
	EUR	100'000.00	25.11.2013	27.05.2019	22 908 250	%	103.440	99.825	27.05.	2.500	2'727.87		N
UniCredit Bank Ireland PLC, Irland													
	CHF	5'000.00	25.10.2012	25.10.2017	19 748 271		-	100.590	25.10.	3.375	168.75		N
Unicredit Bank Ireland PLC (Duplicate of GK188337), Ireland, Irland	CHF	5'000.00	19.10.2012	19.10.2022	19 551 251	%	117.050	100.730	19.10.	4.250	212.50		N
	EUR	1'000.00	28.02.2013	28.02.2018	20 506 720	%	100.240	100.000	28.02.	2.600	21.283		N
UniCredit International Bank (Luxembourg) SA, Luxemburg													
Notes 2009-Without Fixed Maturity VRN Reg-S Subord.	EUR	1'000.00	10.12.2009		10 778 094	%	112.450	100.000	10.06.	VAR.	88.209		N
UniCredit S.p.A., Milano, Italien	AUD	2'000.00	08.05.2014	08.07.2019	24 283 277	%	101.430	99.386	08.07.	5.000	73.422		N
Fixed Rate Resettable Notes 2014-Without Fixed Maturity Variable Rate Reg-S	USD	1'000.00	03.04.2014		24 107 739	%	109.820	100.000	03.06. 03.12.	8.000	38.583 39.390		N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	EUR	1'000.00	31.10.2011	31.10.2017	14 829 492		-	100.000	31.01. 30.04. 31.07. 31.10.	1.671	4.499 4.535 4.752 4.850	N
	EUR	1'000.00	31.10.2013	31.12.2018	22 652 575	%	104.220	100.000	31.12.	3.000	35.104	N
	EUR	800.00	31.12.2012	28.02.2020	20 375 003	%	104.670	100.000	28.02.	4.200	35.755	N
	EUR	800.00	13.08.2013	13.10.2020	22 909 994	%	106.880	100.000	13.10.	4.000	36.905	N
	EUR	1'000.00	31.10.2012	31.10.2022	19 886 356	%	123.210	99.916	31.10.	6.950	80.703	N
	EUR	1'000.00	03.06.2016	03.01.2027	32 728 642	%	108.520	100.000	03.01.	4.375	27.406	N
Unilever Capital Corp, Englewood Cliffs, USA	EUR	1'000.00	21.07.2010	31.12.2050	11 541 423	%	115.630	100.000	21.07.	9.375	103.54	N
Emissionsdisagio von 1.184% 2.8.2017 Em.preis: 98.816%	USD	1'000.00	02.08.2012	02.08.2017	19 170 328		-	98.816	02.02. 02.08. 02.08.	0.850	4.204 4.111 11.453	N
	USD	1'000.00	12.02.2009	15.02.2019	2 882 170	%	102.830	99.897	15.02. 15.08.	4.800	24.202 23.348	N
	USD	1'000.00	10.02.2011	10.02.2021	12 471 554	%	105.310	99.661	10.02. 10.08.	4.250	21.353 20.483	N
Unilever N.V., Rotterdam, Niederlande	USD	1'000.00	12.11.2002	15.11.2032	1 514 411	%	129.930	98.959	15.05. 15.11.	5.900	29.400 29.196	N
	EUR	1'000.00	05.08.2013	05.08.2020	22 012 046	%	104.720	99.635	05.08.	1.750	20.072	N
	EUR	1'000.00	03.02.2015	03.02.2022	26 932 301	%	101.250	98.956	03.02.	0.500	5.361	N
	EUR	1'000.00	31.07.2017	31.07.2025	37 654 634	%	100.870	99.647		0.875	0.000	N
Unilever PLC, London, Grossbritannien												
Emissionsdisagio von 0.606% 16.6.2017 Em.preis: 99.394%	GBP	1'000.00	17.06.2009	16.06.2017	10 269 258		-	99.394	16.06. 16.06.	4.750	59.172 7.549	N
Unione di Banche Italiane S.p.A., Bergamo, Italien												
	EUR	1'000.00	31.03.2014	31.03.2017	24 129 180		-	100.000	31.03.	VAR.	1.616	N
	EUR	1'000.00	31.07.2015	31.07.2017	29 135 904		-	100.000	31.01. 31.07.	0.500	2.687 2.820	N
	EUR	1'000.00	18.11.2011	18.11.2018	14 363 531	%	99.720	100.000	18.02. 18.05. 18.08. 18.11.	VAR.	1.830 1.828 1.898 1.956	N
	EUR	1'000.00	22.01.1999	22.01.2019	992 753	%	100.120	100.000	22.01.	VAR.	6.546	N
	EUR	1'000.00	30.06.2009	30.06.2019	10 318 369	%	99.780	100.000	30.06. 30.12.	1.580	8.923 9.232	N
United Kingdom of Great Britain and Northern Ireland, London, Grossbritannien												
	CNY	10'000.00	21.10.2014	21.10.2017	25 753 057		-	100.000	21.04. 21.10.	2.700	19.588 20.047	N
	GBP	0.010	15.02.2013	22.07.2018	20 656 966	%	100.490	99.860	22.07.	1.250	0.00007	N
	GBP	0.010	26.09.2008	07.03.2019	4 601 374	%	104.810	98.100	07.09.	4.500	0.00028	N
	GBP	0.010	08.07.2009	07.09.2019	10 317 461	%	105.590	99.340	07.09.	3.750	0.00023	N
	GBP	0.010	03.09.2014	22.07.2020	25 319 529	%	103.870	100.337	22.07.	2.000	0.00012	N
	GBP	0.010	10.06.2010	07.09.2020	11 392 653	%	108.750	101.000	07.09.	3.750	0.00023	N
	GBP	0.010	03.09.2015	22.01.2021	29 432 097	%	102.940	100.000	22.07.	1.500	0.00008	N
	GBP	0.010	18.03.2011	07.09.2021	12 659 549	%	111.580	100.800	07.09.	3.750	0.00023	N
	GBP	0.010	27.02.2009	07.03.2022	3 704 593	%	113.980	99.860	07.09.	4.000	0.00024	N
	GBP	0.010	03.08.2016	22.07.2022	33 419 191	%	99.070	100.000	22.07.	0.500	0.00002	N
	GBP	0.010	12.06.2013	07.09.2023	21 579 205	%	107.910	98.960	07.09.	2.250	0.00014	N
	GBP	0.010	12.03.2014	07.09.2024	23 892 997	%	111.880	98.400	07.09.	2.750	0.00017	N
	GBP	0.010	20.03.2015	07.09.2025	27 447 619	%	107.360	103.034	07.09.	2.000	0.00012	N
	GBP	0.010	18.02.2016	22.07.2026	31 499 025	%	103.390	100.000	22.07.	1.500	0.00008	N
	GBP	0.010	15.03.2017	22.07.2027	35 928 402	%	100.120	100.000	22.07.	1.250	0.00004	N
	GBP	0.010	03.10.2007	07.12.2030	3 433 355	%	139.520	99.570	07.12.	4.750	0.00031	N
	GBP	0.010	17.06.2009	07.09.2034	10 271 819	%	142.370	97.850	07.09.	4.500	0.00028	N
	GBP	0.010	09.11.2016	07.09.2037	34 468 946	%	100.190	98.946	07.09.	1.750	0.0001	N
	GBP	0.010	23.04.2004	07.12.2038	1 847 083	%	153.600	99.150	07.12.	4.750	0.00031	N
	GBP	0.010	05.03.2009	07.09.2039	4 475 328	%	145.540	96.120	07.09.	4.250	0.00026	N
	GBP	0.010	30.06.2010	07.12.2040	11 483 809	%	147.390	100.000	07.06. 07.12.	4.250	0.00026 0.00028	N
	GBP	0.010	24.10.2012	22.01.2044	19 892 315	%	130.480	99.594	22.07.	3.250	0.00019	N
	GBP	0.010	25.06.2014	22.01.2045	24 782 997	%	136.860	100.673	22.07.	3.500	0.0002	N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	GBP	0.010	12.05.2006	07.12.2046	2 547 595	%	156.090	100.160	07.12.	4.250	0.00028	N
	GBP	0.010	21.09.2016	22.07.2047	33 969 521	%	94.030	100.000	22.07.	1.500	0.00008	N
	GBP	0.010	03.09.2008	07.12.2049	4 524 663	%	162.170	97.690	07.06. 07.12.	4.250	0.00026 0.00028	N
	GBP	0.010	28.09.2011	22.07.2052	13 950 026	%	154.380	99.838	22.07.	3.750	0.00022	N
	GBP	0.010	27.05.2005	07.12.2055	2 165 856	%	173.960	100.930	07.12.	4.250	0.00028	N
	GBP	0.010	25.01.2017	22.07.2057	35 423 817	%	103.600	96.686	22.07.	1.750	0.00009	N
	GBP	0.010	22.10.2009	22.01.2060	10 683 434	%	172.570	100.000	22.07.	4.000	0.00024	N
	GBP	0.010	21.10.2015	22.07.2065	30 176 778	%	117.000	98.403	22.07.	2.500	0.00014	N
United Parcel Service, Inc., Atlanta, USA	GBP	0.010	26.06.2013	22.07.2068	21 748 126	%	166.940	96.426	22.07.	3.500	0.0002	N
	EUR	1'000.00	20.11.2015	15.07.2020	30 454 163	%	101.140	100.000	17.01. 18.04. 17.07. 16.10.	VAR.	0.32607 0.27821 0.27063 0.28795	N
United States of America, USA												
Emissionsdisagio von 0.677444% 5.1.2017 Em.preis: 99.322556%	USD	100.00	07.01.2016	05.01.2017	30 915 182		-	99.322	05.01.	0.000	0.68428	Y
Emissionsdisagio von 0.535889% 2.2.2017 Em.preis: 99.464111%	USD	100.00	04.02.2016	02.02.2017	31 276 945		-	99.464	02.02.	0.000	0.53013	Y
Emissionsdisagio von 0.667333% 2.3.2017 Em.preis: 99.332667%	USD	100.00	03.03.2016	02.03.2017	31 674 086		-	99.332	02.03.	0.000	0.67459	Y
Emissionsdisagio von 0.407033% 31.8.2017 Em.preis: 99.592967%	USD	100.00	31.08.2012	31.08.2017	19 317 152		-	99.593	28.02. 31.08. 31.08.	0.625	0.31038 0.30278 0.39116	N
31.12.2017 Em.preis: 99.889463%	USD	100.00	31.12.2015	31.12.2017	30 877 006		-	99.889	03.01. 30.06. 31.12. 31.12.	1.000	0.51446 0.46701 0.49124 0.10771	N
	USD	100.00	17.02.2015	15.02.2018	26 997 585	%	99.930	99.853	15.02. 15.08.	1.000	0.5042 0.48243	N
	USD	100.00	30.04.2013	30.04.2018	21 172 368	%	99.720	99.583	30.04. 31.10.	0.625	0.30805 0.31405	N
	USD	100.00	15.02.2011	15.02.2021	12 425 319	%	104.810	99.667	15.02. 15.08.	3.625	1.842 1.748	N
	USD	100.00	30.06.2014	30.06.2021	24 710 676	%	100.170	99.825	30.06. 31.12.	2.125	1.009 1.043	N
	USD	100.00	30.06.2016	30.06.2021	32 891 895	%	96.790	99.550	30.06. 31.12.	1.125	0.53425 0.55264	N
	USD	100.00	15.08.2011	15.08.2021	13 488 782	%	100.070	99.865	15.02. 15.08.	2.125	1.080 1.025	N
	USD	100.00	16.11.2015	15.11.2025	30 298 572	%	99.020	100.148	15.05. 15.11.	2.250	1.111 1.122	N
	USD	100.00	16.02.2016	15.02.2026	31 361 894	%	94.320	99.039	15.02. 15.08.	1.625	0.82607 0.78395	N
	USD	100.00	16.05.2016	15.05.2026	32 456 103	%	94.080	99.221	15.05. 15.11.	1.625	0.8031 0.81074	N
	USD	100.00	15.02.2007	15.02.2037	2 903 362	%	132.860	99.021	15.02. 15.08.	4.750	2.414 2.291	N
United States Steel Corporation, Pittsburgh, USA												
1.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	15.03.2012	15.03.2022	18 171 471		-	100.000	15.03. 01.09.	7.500	37.803 33.290	N
United Utilities Water Limited, Warrington, Grossbritannien												
	EUR	1'000.00	24.01.2005	24.01.2020	2 044 552	%	108.460	98.990	24.01.	4.250	45.789	N
Unitymedia NRW GmbH / Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG, Koeln, Deutschland	GBP	1'000.00	25.03.2009	25.03.2022	10 051 471	%	117.800	100.060	25.03.	5.750	71.080	N
	EUR	1'000.00	21.11.2013	15.01.2029	22 841 910	%	112.120	100.000	15.01. 15.07.	6.250	33.504 34.520	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Vale S.A., Rio de Janeiro, Brasilien												
	EUR	1'000.00	24.03.2010	24.03.2018	11 148 328		-	99.564		4.375		N
24.3.2017 Rückzahlungsagio von 4.982209%									24.03.		53.361	
									24.03.		46.858	
24.3.2017 Emissionsdisagion von 0.436%									24.03.		4.669	
24.3.2017 Em. Preis 99.564%												
	EUR	1'000.00	10.07.2012	10.01.2023	18 979 211	%	112.650	99.608	10.01.	3.750	40.374	N
Vattenfall AB, Vallingby, Schweden												
	EUR	1'000.00	18.06.2003	18.06.2018	1 619 353	%	102.380	99.819	18.06.	5.000	54.382	N
	GBP	1'000.00	15.04.2009	16.12.2019	10 091 350	%	109.830	99.645	16.12.	6.125	80.875	N
	EUR	1'000.00	29.04.2004	29.04.2024	1 841 635	%	128.850	99.148	29.04.	5.375	58.326	N
VEB Finance PLC, Dublin, Irland												
	EUR	1'000.00	21.02.2013	21.02.2018	20 732 499	%	100.250	100.000	21.02.	3.035	32.373	N
	USD	1'000.00	09.07.2010	09.07.2020	11 503 338	%	107.890	100.000	09.01.	6.902	35.082	N
									09.07.		33.364	
VEDES AG, Nuernberg, Deutschland												
	EUR	1'000.00	24.06.2014	24.06.2019	24 594 261		-	100.000	24.06.	7.125	77.452	N
									27.12.		42.676	
Rückzahlungsagio von 2.5%									27.12.		29.385	
24.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Veolia Environnement S.A., Paris, Frankreich												
	EUR	1'000.00	24.11.2006	16.01.2017	2 787 753		-	99.040	16.01.	4.375	47.035	N
Emissionsdisagio von 0.96%									16.01.		10.292	
16.1.2017 Em.preis: 99.04%												
	EUR	1'000.00	28.05.2003	28.05.2018	1 609 104	%	102.180	98.970	28.05.	5.375	58.649	N
	EUR	1'000.00	24.04.2009	24.04.2019	10 125 749	%	108.790	99.752	24.04.	6.750	72.991	N
	EUR	1'000.00	12.12.2005	11.12.2020	2 362 605	%	112.420	98.946	11.12.	4.375	51.119	N
	EUR	50'000.00	06.07.2010	06.01.2021	11 501 464	%	112.220	100.000	06.01.	4.247	2'282.94	N
	EUR	1'000.00	24.05.2007	24.05.2022	3 108 146	%	120.430	99.028	24.05.	5.125	55.982	N
	EUR	1'000.00	25.11.2003	25.11.2033	1 726 662	%	161.320	99.661	25.11.	6.125	71.607	N
Vereinigte Mexikanische Staaten, Mexico D.F., Mexiko												
	MXN	100.00	21.06.2012	15.06.2017	19 092 331		-	100.000	15.06.	5.000	0.13594	N
	USD	1'000.00	30.03.2001	30.12.2019	1 213 513	%	112.700	89.000	30.06.	8.125	38.904	N
									30.12.		39.588	
16.3.2017 Rückkauf ausstehender Titel												
	USD	1'000.00	24.09.2002	24.09.2022	1 489 797	%	124.740	97.248	24.03.	8.000	39.648	N
									24.09.		38.763	
16.3.2017 Rückkauf ausstehender Titel												
	GBP	1'000.00	06.02.2004	06.02.2024	1 775 634	%	123.810	99.497	06.02.	6.750	83.627	N
	MXN	100.00	17.09.2015	05.03.2026	30 154 386	%	87.720	100.000	17.03.	5.750	0.15242	N
									17.09.		0.15885	
Tranche 7 Global	USD	1'000.00	13.08.2001	15.08.2031	1 277 096	%	149.750	92.582	15.02.	8.300	41.849	N
									15.08.		40.373	
	USD	1'000.00	11.04.2003	08.04.2033	1 591 008	%	136.610	98.536	08.04.	7.500	37.802	N
									08.10.		36.734	
	USD	1'000.00	27.09.2004	27.09.2034	1 959 029	%	130.500	98.384	27.03.	6.750	33.188	N
									27.09.		32.897	
Verizon Communications Inc., New York, USA												
	USD	1'000.00	12.02.2008	15.02.2018	3 781 247		-	99.756	15.02.	5.500	27.731	N
									24.04.		10.494	
Emissionsdisagio von 0.244%									24.04.		2.429	
24.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
	USD	1'000.00	28.03.2011	01.04.2021	12 759 610		-	99.145	01.04.	4.600	23.070	N
									01.10.		22.389	
	USD	1'000.00	01.08.2016	15.08.2021	33 440 158	%	97.520	99.564	15.02.	1.750	9.509	N
									15.08.		8.512	
	USD	1'000.00	16.03.2017	16.03.2022	36 059 275	%	100.970	99.487	16.09.	3.125	15.004	N
	USD	1'000.00	07.11.2012	01.11.2022	19 966 193		-	99.895	01.05.	2.450	12.175	N
									01.11.		12.266	
	AUD	10'000.00	17.08.2017	17.02.2023	37 808 279	%	100.390	99.777		3.500	0.000	N
	CHF	5'000.00	31.05.2017	31.05.2023	36 720 666	%	100.400	100.356		0.375	0.000	N
	AUD	10'000.00	17.08.2017	17.02.2025	37 808 276	%	100.640	99.760		4.050	0.000	N
	USD	1'000.00	01.08.2016	15.08.2026	33 440 157	%	93.780	99.745	15.02.	2.625	14.264	N
									15.08.		12.768	
	CHF	5'000.00	31.05.2017	30.11.2027	36 720 667	%	101.300	100.311	30.11.	1.000	25.000	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	USD	1'000.00	13.09.2005	15.09.2035	2 274 910	%	117.590	99.286	15.03. 15.09.	5.850	29.486 28.088	N
	USD	1'000.00	07.11.2012	01.11.2042	19 966 197	%	89.540	99.859	01.05. 01.11.	3.850	19.133 19.275	N
Viacom Inc., New York, NY, USA												
	USD	1'000.00	10.12.2014	15.12.2034	26 305 304	%	95.460	99.543	15.06. 15.12.	4.850	23.639 24.052	N
18.5.2017 Rückkauf ausstehender Titel												
Ville de Paris, St Louis, Frankreich												
	CHF	5'000.00	05.11.2008	05.11.2018	4 625 447	%	103.270	100.943	05.11.	3.250	162.50	N
Vinci, Rueil-Malmaison, Frankreich												
	EUR	100'000.00	19.12.2011	20.02.2017	14 513 084		-	99.318	20.02. 20.02.	4.125	4'402.67 725.92	N
Emissionsdisagio von 0.682% 20.2.2017 Em.preis: 99.318%												
	CHF	5'000.00	15.12.2011	15.12.2017	14 282 139		-	100.667	15.12.	2.125	106.25	N
	CHF	5'000.00	24.01.2012	24.01.2022	14 683 987	%	110.100	100.462	24.01.	3.000	150.00	N
Vivendi SA, Paris, Frankreich												
	EUR	50'000.00	31.03.2010	31.03.2017	11 169 378		-	99.378	31.03. 31.03.	4.000	2'141.10 332.94	N
Emissionsdisagio von 0.622% 31.3.2017 Em.preis: 99.378%												
	EUR	50'000.00	01.12.2009	02.12.2019	10 777 248	%	108.990	99.728	02.12.	4.875	2'844.44	N
Vodafone Group Plc, Newbury, Grossbritannien												
	USD	1'000.00	27.02.2007	27.02.2017	2 953 003		-	99.630	27.02. 27.02.	5.625	28.282 3.720	N
27.2.2017 Emissionsdisagio von 0.37% 27.2.2017 Em.preis: 99.63%												
	USD	1'000.00	20.03.2012	20.03.2017	18 178 524		-	99.447	20.03. 20.03.	1.625	8.097 5.511	N
Emissionsdisagio von 0.553% 20.3.2017 Em.preis: 99.447%												
Tranche 1	USD	1'000.00	26.09.2012	26.09.2017	19 616 007		-	99.691	26.03. 14.08. 14.08. 14.08. 26.09.	1.250	6.146 4.648 2.997 0.20372 6.067	N
Emissionsdisagio von 0.309% Rückzahlungsagio von 0.021% 14.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
	GBP	1'000.00	05.06.2009	05.12.2017	10 241 298		-	99.383	05.12. 05.12.	5.375	71.413 8.197	N
Emissionsdisagio von 0.617% 5.12.2017 Em.preis: 99.383%												
Tranche 2	USD	1'000.00	19.02.2013	19.02.2018	20 696 526	%	99.820	99.540	19.02. 19.08.	1.500	7.516 7.202	N
	EUR	1'000.00	04.06.2003	04.06.2018	1 615 664	%	102.160	99.922	04.06.	5.000	54.270	N
	USD	1'000.00	26.06.2003	15.07.2018	1 629 448	%	101.260	99.258	15.01. 15.07.	4.625	23.379 22.269	N
	GBP	1'000.00	26.11.2008	26.11.2018	4 846 257	%	106.070	99.387	26.11.	8.125	106.30	N
	USD	1'000.00	10.06.2009	10.06.2019	10 254 859	%	104.270	99.741	10.06. 10.12.	5.450	26.409 26.993	N
	USD	1'000.00	16.03.2011	16.03.2021	12 669 429	%	105.730	99.288	16.03. 16.09.	4.375	21.774 21.005	N
	EUR	1'000.00	20.01.2010	20.01.2022	10 916 885	%	117.000	99.693	20.01.	4.650	50.054	N
	EUR	1'000.00	06.06.2007	06.06.2022	3 146 318	%	121.230	99.637	06.06.	5.375	58.348	N
Tranche 2	USD	1'000.00	26.09.2012	26.09.2022	19 616 009	%	99.050	98.699	26.03. 26.09.	2.500	12.292 12.134	N
Tranche 3	USD	1'000.00	19.02.2013	19.02.2023	20 696 531	%	100.340	99.537	19.02. 19.08.	2.950	14.781 14.165	N
	CHF	5'000.00	03.06.2016	03.12.2024	32 542 918	%	101.150	100.167	03.12.	0.375	18.750	N
	EUR	1'000.00	11.09.2014	11.09.2025	25 417 138	%	105.400	98.913	11.09.	1.875	21.390	N
	CHF	5'000.00	15.03.2017	15.03.2027	35 752 046	%	99.550	100.363		0.625	0.000	N
	USD	1'000.00	10.02.2000	15.02.2030	1 174 972	%	135.550	98.696	15.02. 15.08.	7.875	39.706 38.306	N
	CHF	5'000.00	19.09.2016	19.09.2031	33 782 926	%	95.000	101.343	19.09.	0.500	25.000	N
	USD	1'000.00	26.11.2002	30.11.2032	1 521 921	%	123.550	99.972	30.05. 30.11.	6.250	30.478 30.686	N
	USD	1'000.00	27.02.2007	27.02.2037	2 953 388	%	123.890	99.390	27.02. 27.08.	6.150	30.922 29.367	N
Tranche 4	USD	1'000.00	19.02.2013	19.02.2043	20 696 535	%	102.530	98.716	19.02. 19.08.	4.375	21.922 21.007	N
Voestalpine AG, Linz, Österreich												
Obl. zum Umtausch 2013-ohne festen Verfall var.	EUR	1'000.00	20.03.2013		20 798 042	%	109.080	100.000	31.10.	6.000	69.672	N
	EUR	1'000.00	03.02.2011	05.02.2018	12 403 118	%	100.260	100.888	05.02.	4.750	50.780	N

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	EUR	500.00	14.10.2014	14.10.2021	25 685 281	%	105.170	101.417	14.10.	2.250	12.942	N
Voith GmbH & Co. KGaA, Heidenheim an der Brenz, Deutschland												
Emissionsdisagio von 0.567% 21.6.2017 Em.preis: 99.433%	EUR	1'000.00	21.06.2007	21.06.2017	3 207 329		-	99.433	21.06. 21.06.	5.375	58.383 6.158	N
VOLKSBANK WIEN AG, Wien, Österreich												
	EUR	100'000.00	06.10.2017	06.10.2027	38 500 366	%	99.310	99.747		2.750	0.000	N
Volksrepublik China, Beijing, China (Volksrepublik)												
	CNY	500'000.00	21.11.2014	21.11.2017	26 114 181		-	100.000	21.05. 21.11.	2.740	958.76 1'033.05	N
	CNY	500'000.00	18.08.2011	18.08.2018	13 566 683	%	98.780	100.000	18.02. 18.08.	1.940	712.46 692.53	N
	CNY	500'000.00	01.12.2010	01.12.2020	12 104 212	%	95.800	100.000	01.06. 01.12.	2.480	880.84 925.96	N
	CNY	500'000.00	29.06.2012	29.06.2022	18 942 783	%	96.050	100.000	29.06. 29.12.	3.100	1'090.79 1'162.90	N
	CNY	500'000.00	21.11.2014	21.11.2024	26 114 195	%	95.300	100.000	21.05. 21.11.	3.380	1'182.71 1'274.34	N
Volkswagen Bank GmbH, Braunschweig, Deutschland	CNY	100.00	29.06.2012	29.06.2027	18 942 785	%	94.370	100.000	29.06. 29.12.	3.480	0.2449 0.26109	N
	EUR	1'000.00	08.05.2013	08.02.2018	21 311 328	%	100.120	99.482	08.02.	1.125	11.998	N
Volkswagen Financial Services AG, Braunschweig, Deutschland												
	EUR	1'000.00	14.04.2015	14.10.2021	27 820 853	%	101.510	99.938	14.10.	0.750	8.628	N
Volkswagen Financial Services Australia Pty Ltd, Sydney, Australien												
Emissionsdisagio von 0.784% 27.6.2017 Em.preis: 99.216%	AUD	10'000.00	27.06.2012	27.06.2017	18 896 602		-	99.216	27.06. 27.06.	5.000	182.63 57.430	N
	AUD	10'000.00	04.04.2014	04.04.2018	24 124 177	%	100.380	99.510	04.04. 04.10.	4.250	160.39 163.06	N
	AUD	10'000.00	13.08.2015	13.08.2019	29 183 789	%	100.880	99.731	13.02. 13.08.	3.250	125.82 122.99	N
	AUD	10'000.00	21.11.2014	21.11.2019	26 090 125	%	102.340	100.000	21.05. 21.11.	4.000	144.42 151.67	N
	AUD	10'000.00	22.06.2017	22.06.2020	37 154 031	%	100.150	99.822	22.12.	2.950	112.98	N
Volkswagen Financial Services NV, Amsterdam, Niederlande	AUD	10'000.00	14.09.2017	14.09.2022	38 233 253	%	100.130	99.383		3.500	0.000	N
	CAD	2'000.00	05.04.2013	05.04.2017	21 055 449		-	101.355	05.04.	2.125	31.810	N
Emissionsdisagio von 0.329% 15.5.2017 Em.preis: 99.671%	NOK	10'000.00	15.05.2014	15.05.2017	24 410 038		-	99.671	15.05. 15.05.	2.250	26.252 3.838	N
Emissionsdisagio von 0.422% 21.8.2017 Em.preis: 99.578%	GBP	1'000.00	21.08.2013	21.08.2017	22 134 262		-	99.578	21.02. 21.08. 21.08.	1.750	11.105 10.756 5.230	N
Emissionsdisagio von 0.273% 22.8.2017 Em.preis: 99.727%	NOK	10'000.00	22.08.2014	22.08.2017	25 220 966		-	99.727	22.08. 22.08.	2.000	24.485 3.342	N
	NOK	10'000.00	22.01.2015	22.01.2018	26 727 748	%	100.170	99.693	22.01.	1.125	13.469	N
	NOK	10'000.00	16.04.2015	16.04.2018	27 848 368	%	100.270	99.971	16.04.	1.375	16.138	N
	NOK	10'000.00	17.09.2015	17.09.2018	29 678 941	%	100.130	99.942	17.09.	1.375	16.895	N
	NZD	2'000.00	30.01.2015	30.01.2019	26 821 850	%	101.440	99.562	30.01.	4.250	61.889	N
	NZD	2'000.00	28.08.2014	28.02.2019	25 238 167	%	102.120	99.638	28.02.	4.875	70.813	N
Volkswagen Group of America Finance LLC, Herndon, USA	NOK	10'000.00	12.04.2017	14.04.2020	36 401 375	%	101.060	99.730		1.750	0.000	N
	USD	1'000.00	22.05.2015	22.05.2018	28 320 170	%	99.820	99.875	22.05. 22.11.	1.650	8.024 8.112	N
Volkswagen International Finance NV, Amsterdam, Niederlande												
Notes 2013-Without Fixed Maturity Variable Rate Senior	EUR	1'000.00	04.09.2013		22 252 196	%	115.410	98.880	04.09.	5.125	58.371	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Subordinated Notes 2013-Without Fixed Maturity Variable Rate Subord.	EUR	1'000.00	04.09.2013		22 252 625	%	102.150	99.213	04.09.	3.875	44.134	N
Undated Subordinated Notes 2014-Without Fixed Maturity Variable Rate Junior Subord.	EUR	1'000.00	24.03.2014		23 993 938	%	106.960	99.246	24.03.	3.750	40.164	N
	USD	1'000.00	22.03.2012	22.03.2017	18 231 702		-	99.355	22.03.	2.375	11.754	N
Emissionsdisagio von 0.645% 22.3.2017 Em.preis: 99.355%									22.03.		6.384	
	EUR	1'000.00	15.05.2012	15.05.2017	18 581 020		-	99.378	15.05.	1.875	20.515	N
Emissionsdisagio von 0.622% 15.5.2017 Em.preis: 99.378%									15.05.		6.805	
	NOK	10'000.00	22.08.2012	22.08.2017	19 288 437		-	99.771	22.08.	3.000	36.727	N
22.8.2017 Emissionsdisagio von 0.229% 22.8.2017 Em.preis: 99.771%									22.08.		2.803	
	CNY	1'000'000.00	30.11.2012	30.11.2017	20 103 890		-	100.000	30.05.	3.750	2'643.44	N
									30.11.		2'808.03	
	EUR	1'000.00	22.05.2003	22.05.2018	1 607 892	%	102.010	98.970	22.05.	5.375	58.810	N
	EUR	1'000.00	16.01.2015	16.07.2018	26 643 895	%	100.090	100.000	16.01.	VAR.	0.000	N
									18.04.		0.000	
									17.07.		0.000	
									16.10.		0.000	
	EUR	1'000.00	19.01.2012	21.01.2019	14 725 546	%	103.480	99.384	21.01.	3.250	34.976	N
	CNY	1'000'000.00	23.01.2014	23.01.2019	23 440 597	%	99.290	100.000	23.01.	3.500	2'570.31	N
									23.07.		2'432.27	
	USD	1'000.00	12.08.2010	12.08.2020	11 615 640	%	103.370	99.105	12.02.	4.000	20.101	N
									12.08.		19.402	
	EUR	1'000.00	26.03.2013	26.03.2021	21 014 573	%	105.730	99.423	26.03.	2.000	21.407	N
	EUR	1'000.00	16.01.2015	16.01.2023	26 643 820	%	101.380	99.082	16.01.	0.875	9.407	N
Volkswagen Leasing GmbH, Braunschweig, Deutschland												
	EUR	100'000.00	10.11.2011	10.05.2018	14 237 914	%	101.120	99.289	10.05.	3.250	3'562.16	N
	EUR	1'000.00	11.08.2015	11.08.2020	29 151 624	%	101.580	99.566	11.08.	0.750	8.514	N
	EUR	1'000.00	15.01.2014	15.01.2024	23 296 925	%	109.600	98.920	15.01.	2.625	28.221	N
Volvo Treasury AB, Goteborg, Schweden												
	EUR	1'000.00	31.05.2007	31.05.2017	3 130 785		-	99.423	31.05.	5.000	54.400	N
Emissionsdisagio von 0.577% 31.5.2017 Em.preis: 99.423%									31.05.		6.277	
	EUR	1'000.00	26.11.2012	26.11.2019	20 074 514	%	104.530	99.943	26.11.	2.375	27.766	N
VP Bank AG, Vaduz, Liechtenstein												
	CHF	5'000.00	07.04.2015	07.04.2021	26 288 893	%	101.550	100.740	07.04.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	07.04.2015	07.10.2024	26 288 894	%	104.700	100.890	07.10.	0.875	43.750	N
VTB Capital SA, Luxemburg												
	AUD	1'000.00	11.12.2012	11.12.2017	20 198 438		-	100.000	11.12.	7.500	56.035	N
	CHF	5'000.00	25.11.2013	25.05.2018	22 674 774	%	100.850	100.000	25.05.	2.900	145.00	N
	CHF	5'000.00	24.07.2014	24.10.2024	24 853 111	%	103.800	100.000	24.10.	5.000	250.00	N
VTB Eurasia Designated Activity Company, Dublin, Irland												
Loan Participation Notes 2012- Without Fixed Maturity VRN -VTB BANK OJSC-	USD	1'000.00	06.08.2012		19 150 917	%	110.460	100.000	06.06.	9.500	45.771	N
									06.12.		47.014	

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
Walgreens Boots Alliance, Inc., Deerfield, USA												
	GBP	1'000.00	20.11.2014	20.11.2020	26 057 875	%	103.630	99.756	20.11.	2.875	37.788	N
	USD	1'000.00	13.09.2012	15.09.2022	19 493 240	%	99.890	99.889	15.03. 15.09.	3.100	15.625 14.884	N
Wal-Mart Stores Inc., Bentonville, USA												
	USD	1'000.00	24.08.2007	15.02.2018	3 345 038	%	100.290	99.823	15.02. 15.08.	5.800	29.244 28.213	N
	USD	1'000.00	08.07.2010	08.07.2020	11 497 597	%	103.510	99.908	08.01. 08.07.	3.625	18.425 17.523	N
6.10.2017 Rückkauf ausstehender Titel												
	USD	1'000.00	25.10.2010	25.10.2020	11 905 941	%	102.920	99.619	25.04. 25.10.	3.250	16.141 16.087	N
	USD	1'000.00	18.04.2011	15.04.2021	12 867 670	%	106.120	99.349	15.04. 15.10.	4.250	21.284 20.722	N
	EUR	1'000.00	21.09.2009	21.09.2029	10 561 676	%	138.910	99.074	21.09.	4.875	56.554	N
	GBP	1'000.00	19.12.2000	19.12.2030	1 166 074	%	141.060	99.321	19.06. 19.12.	5.750	35.718 37.901	N
15.6.2017 Rückkauf ausstehender Titel												
Walt Disney Company, (The), Burbank, USA												
	USD	1'000.00	12.07.2016	12.07.2019	33 231 628	%	98.000	99.664	12.01. 12.07.	0.875	4.410 4.218	N
	USD	1'000.00	13.09.2017	13.09.2022	38 223 931	%	97.500	99.583		2.125	0.000	N
Wells Fargo & Company, San Francisco, USA												
	USD	1'000.00	10.12.2007	11.12.2017	3 605 840		-	99.584	11.06. 11.12. 11.12.	5.625	27.257 27.860 4.120	N
Emissionsdisagio von 0.416% 11.12.2017 Em.preis: 99.584%												
	AUD	10'000.00	08.08.2014	08.08.2019	25 079 145	%	102.280	99.731	08.02. 08.08.	4.000	153.17 152.87	N
	CHF	5'000.00	03.09.2014	03.09.2020	24 790 290	%	102.150	100.456	03.09.	0.625	31.250	N
	AUD	1'000.00	27.07.2016	27.07.2021	33 367 327	%	99.840	99.414	27.01. 27.07.	3.000	11.402 11.422	N
	CHF	5'000.00	02.06.2015	02.06.2022	27 887 597	%	101.500	100.484	02.06.	0.375	18.750	N
	CHF	5'000.00	02.11.2015	02.11.2023	29 947 735	%	102.150	100.117	02.11.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	03.09.2014	03.09.2024	24 790 291	%	106.800	100.513	03.09.	1.250	62.500	N
	GBP	1'000.00	26.07.2016	28.07.2025	33 361 071	%	99.800	99.795	28.07.	2.000	25.556	N
	USD	1'000.00	04.11.2014	04.11.2044	25 932 398	%	108.820	99.312	04.05. 04.11.	4.650	23.036 23.263	N
Wendel Investissement, Paris, Frankreich												
	EUR	50'000.00	09.08.2005	09.08.2017	2 220 466		-	99.551	09.08. 09.08.	4.375	2'480.95 254.61	N
Emissionsdisagio von 0.449% 9.8.2017 Em.preis: 99.551%												
	EUR	100'000.00	17.09.2012	17.09.2019	19 483 624	%	109.970	100.000	18.09.	5.875	6'762.68	N
Westfarmers Limited, Perth, Australien												
	USD	1'000.00	20.03.2013	20.03.2018	20 955 667	%	100.010	100.000	20.03. 20.09.	1.874	9.338 9.012	N
	EUR	1'000.00	02.08.2012	02.08.2022	19 127 895	%	110.650	99.098	02.08.	2.750	31.541	N
Westpac Banking Corporation, Sydney, Australien												
	CHF	5'000.00	16.02.2010	16.02.2017	10 915 613		-	100.827	16.02.	2.500	125.00	N
1.6 % Notes 2013-12.1.18 Sr	USD	1'000.00	14.01.2013	12.01.2018	20 413 070	%	99.880	99.971	12.01. 12.07.	VAR.	8.064 7.713	N
	USD	1'000.00	30.07.2013	30.07.2018	21 982 488	%	100.210	100.000	30.01. 30.04. 30.07. 30.10.	VAR.	4.101 4.420 4.662 4.817	N
	AUD	2'000.00	04.09.2013	04.09.2018	22 185 929	%	101.660	101.335	04.09.	4.500	68.441	N
	CHF	5'000.00	21.12.2009	21.12.2018	10 774 613	%	103.670	100.866	21.12.	3.125	156.25	N
	AUD	2'000.00	16.04.2013	16.04.2019	21 135 658	%	102.840	100.633	16.04.	4.375	66.664	N
	CAD	2'000.00	31.07.2014	31.07.2019	24 988 305	%	100.300	101.372	31.07.	2.250	34.720	N
	GBP	1'000.00	21.10.2009	21.10.2019	10 663 810	%	107.220	99.696	21.10.	5.000	65.000	N
	AUD	2'000.00	02.07.2014	06.11.2019	24 776 908	%	102.510	101.000	06.11.	4.000	61.325	N
	USD	1'000.00	19.11.2009	19.11.2019	10 749 234	%	104.680	99.929	19.05. 19.11.	4.875	23.753 24.157	N
	AUD	2'000.00	10.12.2013	10.12.2019	23 022 915	%	104.230	101.320	10.12.	4.875	72.845	N
	AUD	2'000.00	19.03.2014	19.03.2021	23 928 588	%	106.210	101.458	19.03.	5.000	77.071	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP
	AUD	2'000.00	20.08.2014	20.08.2021	25 140 033	%	104.650	99.834	20.08.	4.375	66.725	N
	CHF	5'000.00	02.02.2015	02.02.2022	25 589 306	%	102.300	100.793	02.02.	0.500	25.000	N
	CHF	5'000.00	09.06.2015	09.06.2023	28 234 376	%	101.800	100.098	09.06.	0.400	20.000	N
	CHF	5'000.00	28.11.2017	28.11.2025	38 787 905	%	100.350	100.316		0.300	0.000	N
Westpac Securities NZ Ltd, London Branch, London, Grossbritannien												
	NZD	2'000.00	03.10.2014	03.10.2019	25 526 111	%	103.890	99.892	03.10.	5.125	71.410	N
	NZD	2'000.00	15.04.2015	15.04.2020	27 832 531	%	102.270	99.577	15.04.	4.250	59.895	N
	CHF	5'000.00	02.09.2014	02.09.2020	24 586 588	%	102.250	100.148	02.09.	0.625	31.250	N
	NZD	2'000.00	11.07.2017	11.07.2022	37 422 509	%	102.000	100.000		3.875	0.000	N
	CHF	5'000.00	03.08.2017	15.12.2022	37 331 489	%	100.450	100.258	15.12.	0.125	2.291	N
	CHF	5'000.00	05.02.2016	05.02.2024	30 677 060	%	101.400	100.217	05.02.	0.375	18.750	N
WIENER STAEDTISCHE Versicherung AG Vienna Insurance Group, Wien, Österreich												
Tranche 1	EUR	1'000.00	11.05.2017	11.05.2027	36 586 609	%	104.500	100.000		3.500	0.000	N
Wind Acquisition Finance SA, Luxemburg												
	EUR	1'000.00	10.07.2014	15.07.2020	24 784 453		-	100.000	17.01. 15.07. 03.11.	4.000	21.445 22.093 13.944	N
Rückzahlungsagio von 1% 3.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung									03.11.		11.620	
Wm Morrison Supermarkets PLC, Bradford, Grossbritannien												
	EUR	1'000.00	19.06.2013	19.06.2020	21 639 150	%	104.280	99.374	19.06.	2.250	24.472	N
Woodside Finance Ltd, Perth, Australien												
	CHF	5'000.00	11.07.2016	11.12.2023	33 004 983	%	104.350	100.003	11.12.	1.000	50.000	N
WT 80 Immobilien-Business GmbH, Wien, Österreich												
	CHF	1'000.00	04.12.2015	04.12.2020	30 669 724	%	99.520	100.000	04.06. 04.12.	4.125	20.568 20.681	N
Wuerttembergische Lebensversicherung AG (vormals Allgemeine Rentenanstalt Lebens- & Rentenvers.-AG), Stuttgart, Deutschland												
	EUR	1'000.00	12.05.2014	15.07.2044	24 410 072	%	116.450	99.966	15.07.	5.250	57.994	N
Würth Finance International BV, Hertogenbosch, Niederlande												
	EUR	1'000.00	25.05.2011	25.05.2018	13 014 428	%	101.470	99.354	25.05.	3.750	40.880	N
	EUR	1'000.00	21.05.2013	21.05.2020	21 418 445	%	104.220	99.948	21.05.	1.750	19.147	N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	 %	 Brutto brut lordo CHF		IUP
Xerox Corporation, Norwalk, USA													
	USD	1'000.00	18.05.2011	15.05.2021	13 040 159	%	103.810	99.246	15.05. 15.11.	4.500	22.424 22.268		N

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Em.preis Prix d'ém. Prezzo di emis. CHF/%	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF		IUP
Yapi ve Kredi Bankasi A.S., Istanbul, Türkei													
	USD	1'000.00	08.02.2012	08.02.2017	14 917 045		-	98.960	08.02.	6.750	33.527		N
Emissionsdisagio von 1.04% 8.2.2017 Em.preis: 98.96%									08.02.		10.331		
YPF SA, Buenos Aires, Argentinien													
	CHF	5'000.00	30.09.2016	30.09.2019	33 635 282	%	103.250	100.000	30.09.	3.750	187.50		N
	USD	1'000.00	28.04.2015	28.07.2025	28 028 774	%	115.850	99.097	28.01.	8.500	42.378		N
									28.07.		41.170		

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Optionsanleihen / Emprunts à option / Obbligazioni a opzione

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** %	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	 gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	 %	 Brutto brut lordo CHF	IUP	HinweisAvertissementNota
Siemens Financieringsmaatschappij Nv, Den Haag, Niederlande													
exkl. Optionsschein	USD	250'000.00	16.02.2012	16.08.2017	14 980 418	-	94.000	100.000	16.02. 16.08. 16.08.	1.050	1'310.71 1'280.03 14'628.96	N	
exkl. Optionsschein	USD	250'000.00	16.02.2012	16.08.2019	14 980 420	98.600	92.000	100.000	16.02. 16.08.	1.650	2'059.69 2'011.48	N	

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** %	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP	HinweisAvertissementNota
ACS Actividades Finance 2 B.V., Amsterdam, Niederlande													
1.625 % Exchangeable Bonds 2014-27.3.19 Conv.on Iberdrola SA Shs Reg-S Secured	EUR	100'000.00	27.03.2014	27.03.2019	23 971 315	114.010		100.000	27.03.	1.625	428.87	Y	
									27.06.		446.06		
									27.09.		468.36		
									27.12.		476.19		
Adidas AG, Herzogenaurach, Deutschland													
1/4 % 2012-14.6.19 wandelbar	EUR	200'000.00	21.03.2012	14.06.2019	18 196 613	202.550		100.000	14.06.	0.250	544.97	Y	
Airbus SE, Leiden, Niederlande													
0 % Convertible Bonds 2015-1.7.22 Conv.Reg-S Secured	EUR	100'000.00	01.07.2015	01.07.2022	28 741 390	113.190	94.386	100.000		0.000	0.000	Y	
Altaba Inc., Sunnyvale, USA													
0 % Notes 2014-1.12.18 Sr Conv	USD	1'000.00	26.11.2013	01.12.2018	26 358 199	134.530		100.000		0.000	0.000	Y	
América Móvil, S.A.B. de C.V., México, Mexiko													
0 % Notes 2015-28.5.20 Conv.on Koninklijke KPN NV Shs Senior	EUR	100'000.00	28.05.2015	28.05.2020	28 334 082	98.790	98.185	100.000		0.000	0.000	Y	
Ares Capital Corp., New York, USA													
4.375 % Notes 2014-15.1.19 Sr Conv	USD	1'000.00	15.07.2014	15.01.2019	24 869 117	101.870		100.000	15.01.	4.375	22.115	Y	
									15.07.		21.065		
AXA SA, Paris, Frankreich													
(Obl. EUR 165.50 nom. = 4.15 Akt. Axa SA)	EUR	165.50	17.02.2000	01.01.2017	1 047 083	-	76.426	100.000	02.01.	3.750	6.648	N	

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** %	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP	HinweisAvertissementNota
Balfour Beatty Finance No.2 Limited, St Helier, Jersey													
1.875 % Regd.Convertible Bonds 2013-3.12.18 Conv.on Balfour Beatty Plc Shs Reg-S Senior	GBP	100'000.00	03.12.2013	03.12.2018	22 881 303	97.600		100.000	03.06. 03.12.	1.875	1'166.27 1'247.73	Y	
Bayer Capital Corporation BV, Mijdrecht, Niederlande													
5.625 % Wandelanleihe 2016-22.11.19 Unitary 144A/Reg S	EUR	100'000.00	22.11.2016	22.11.2019	34 682 875	112.050		100.000	01.07.	5.625	3'728.86	Y	
British Land (Jersey) Limited, St Helier, Jersey													
1 1/2 % Convertible Bonds 2012-10.9.17 Conv.on British Land Co Plc R.E.I.T. Shs Reg-S	GBP	100'000.00	10.09.2012	10.09.2017	19 438 088	-		100.000	10.03. 10.09.	1.500	921.81 941.45	Y	

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** %	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP	HinweisAvertissementNota
CapitaLand Limited, Singapur													
1.85 % Regd.Convertible Bonds 2013-19.6.20 Conv.Reg-S	SGD	250'000.00	19.06.2013	19.06.2020	21 462 201	98.000		100.000	19.06.	1.850	1'621.29	Y	
									19.12.		1'698.54		
Citigroup Global Markets Funding Luxembourg S.C.A., Luxemburg													
0.5 % Exchangable Global Medium Term Notes 2016-04.08.23 Gtd Global into Shs Telekom Austria Reg S	EUR	100'000.00	04.08.2016	04.08.2023	33 489 596	113.820		100.000	04.08.	0.500	571.67	Y	
Citrix Systems, Inc., Fort Lauderdale, USA													
0.5 % Notes 2015-15.4.19 Sr Conv	USD	1'000.00	15.04.2015	15.04.2019	28 093 306	130.010		100.000	15.04. 15.10.	0.500	2.504 2.437	Y	
Corporacion Delta, Barcelona, Spanien													
1 % Exchangeable Notes 2016-01.12.23 Gtd Secured Exch into Ebro Foods Reg S	EUR	100'000.00	01.12.2016	01.12.2023	34 718 235	99.580		100.000	01.06.	1.000	542.63	N	
									01.12.		585.52		

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** %	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP	Hinweis\Avertissement\Nota
Detour Gold Corporation, Toronto, Kanada													
5 1/2 % Notes 2010-30.11.17 Conv (reine Differenzbesteuerung)	USD	1'000.00	01.12.2010	30.11.2017	12 057 962	-		100.000	31.05. 30.11.	5.500	26.534 27.078	Y	
Deutsche Post AG, Bonn, Deutschland													
0.6 % 2012-6.12.19 wandelbar.	EUR	100'000.00	06.12.2012	06.12.2019	20 185 271	184.970	96.293	100.000	06.12.	0.600	700.11	N	
DP World Ltd, Dubai, Vereinigte Arabische Emirate													
1 3/4 % Notes 2014-19.6.24 Conv.Senior	USD	200'000.00	19.06.2014	19.06.2024	24 700 194	102.940		100.000	19.06. 19.12.	1.750	1'704.32 1'728.06	Y	

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** %	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP	HinweisAvertissementNota
First Abu Dhabi Bank P.J.S.C., Abu Dhabi, Vereinigte Arabische Emirate													
1 % Regd.Convertible Bonds 2013-12.3.18 Conv.Reg-S Senior	USD	200'000.00	05.06.2013	12.03.2018	21 497 353	94.600	99.268	100.000	12.03.	1.000	1'006.84	N	
									12.09.		959.67		
Foncière des Régions SA, Metz, Frankreich													
0.875 % 2013-1.4.19 Convertible into fonc. des reg. shares	EUR	84.73	20.11.2013	01.04.2019	22 873 160	120.110		84.730	01.04.	0.875	0.39608	Y	
									02.10.		0.42349		

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017**	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2017			IUP	HinweisAvertissement\Nota
							Em.preis prix d'ém. prezzo di em.	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar.	Datum Date Data		Brutto brut lordo		
						%	%	%		%	CHF		
GBL Verwaltung S.A., Luxemburg													
1 1/4 % Guaranteed Exchangeable Bonds 2013-7.2.17 Conv.on GDF Suez SA Shs Reg-S Senior	EUR	100'000.00	07.02.2013	07.02.2017	20 564 801	-		100.000	07.02.	1.250	1'336.21	N	
Golar LNG Limited, Hamilton, Bermuda													
3 3/4 % 2012-07.03.2017 conv.	USD	100'000.00	07.03.2012	07.03.2017	18 098 328	-		100.000	07.03.	3.750	937.11	Y	

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

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 **31.12.2017** %	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	 gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	 % %	 Brutto brut lordo CHF	IUP	Hinweis\Avertissement\Nota
Iberdrola International BV, Amsterdam, Niederlande													
0 % Equity-Linked Bonds 2015-11.11.22 Conv. on Iberdrola SA Shs Reg-S	EUR	100'000.00	16.11.2015	11.11.2022	30 380 805	99.910		100.000		0.000	0.000	Y	
Intel Corporation, Santa Clara, USA													
"reine Differenzbesteuerung" 2.95 % Debs 2005-15.12.35 Jr Subord Conv 18.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	16.12.2005	15.12.2035	2 435 583	-		100.000	15.06. 18.12.	2.950	16.957 17.226	Y	

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

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 **31.12.2017**	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2017			IUP	HinweisAvertissementNota
							Em.preis prix d'ém. prezzo di em.	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar.	Datum Date Data		Brutto brut lordo		
						%	%	%		%	CHF		
J Sainsbury plc, London, Grossbritannien													
1.25 % Notes 2014-21.11.19 Conv. Reg-S Senior	GBP	100'000.00	21.11.2014	21.11.2019	26 111 537	100.800		100.000	21.05. 21.11.	1.250	784.75 827.20	Y	

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

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 **31.12.2017**	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2017			IUP	HinweisAvertissementNota
							Em.preis prix d'ém. prezzo di em.	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar.	Datum Date Data		Brutto brut lordo		
						%	%	%		%	CHF		
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE, Paris, Frankreich													
0 % 2016-16.2.21 Convertible bond	USD	257.50	16.02.2016	16.02.2021	31 434 222	357.120	94.438	100.000		0.000	0.000	Y	

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

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 **31.12.2017**	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2017			IUP	HinweisAvertissementNota
							Em.preis prix d'ém. prezzo di em.	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar.	Datum Date Data		Brutto brut lordo		
						%	%	%		%	CHF		
Minaya Capital AG, Hoerselberg/ Hainich, Deutschland													
7 % 2013-1.8.18 wandelbar	EUR	1'000.00	01.08.2013	01.08.2018	22 231 295	63.630		100.000	01.08.	7.000	79.831	N	

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

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 **31.12.2017**	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2017			IUP	HinweisAvertissementNota
							Em.preis prix d'ém. prezzo di em.	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar.	Datum Date Data		Brutto brut lordo		
						%	%	%		%	CHF		
Nichias Corporation, Minato-ku, Japan													
0 % Convertible Notes 2012-02.08.17 Reg S	JPY	5'000'000.00	02.08.2012	02.08.2017	18 979 229	-		100.000		0.000	0.000	Y	

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

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 **31.12.2017**	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2017			IUP	HinweisAvertissementNota
							Em.preis prix d'ém. prezzo di em.	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar.	Datum Date Data		Brutto brut lordo		
						%	%	%		%	CHF		
ORPAR, Cognac, Frankreich													
0% notes 2015-15.7.19 exchangeable into Remy Cointreau shares 5.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	100'000.00	12.02.2015	15.07.2019	27 039 377	-		102261.300		0.000	0.000	Y	

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017**	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2017			IUP	HinweisAvertissement\Nota
							Em.preis prix d'ém. prezzo di em.	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar.	Datum Date Data		Brutto brut lordo		
						%	%	%		%	CHF		
Qiagen N.V., Venlo, Niederlande													
0.875 % Regd.Notes 2014-19.3.21 Conv.Reg-S Senior	USD	200'000.00	19.03.2014	19.03.2021	23 968 728	119.190		100.000	19.03.	0.875	872.07	Y	
									19.09.		842.42		

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** %	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	 gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	 %	 Brutto brut lordo CHF	IUP	Hinweis\Avertissement\Nota
RAG-Stiftung, Essen, Deutschland													
0 % 2014-31.12.18 wandelbar	EUR	100'000.00	11.06.2014	31.12.2018	24 632 529	103.090		100.000		0.000	0.000	Y	
0 % 2015-18.2.21 wandelbar Reg S	EUR	100'000.00	18.02.2015	18.02.2021	27 138 661	109.330		100.000		0.000	0.000	Y	
Rallye SA, Paris, Frankreich													
5.25 % Exchangeable Notes 2016-1.2.22 Exchangeable in Casino shares	EUR	100'000.00	26.10.2016	01.02.2022	34 349 054	100.000		100.000	26.04. 26.10.	5.250	2'839.85 3'061.40	N	
Royal BAM Group nv, Bunnik, Niederlande													
3 1/2 % Convertible Notes 2016-13.06.21	EUR	100'000.00	13.06.2016	13.06.2021	32 849 867	100.000		100.000	13.06. 13.12.	3.500	1'893.63 2'040.73	Y	

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** %	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP	HinweisAvertissementNota
SAFRAN SA, Paris, Frankreich													
0 % 2016-31.12.20 Conv./exch. in shares of SAFRAN	EUR	89.32	08.01.2016	31.12.2020	30 995 815	118.240		89.320		0.000	0.000	Y	
Sagerpar SA, Bruxelles, Belgien													
0.375 % Convertible Bonds Reg 2013-9.10.18 Conv. Reg S	EUR	100'000.00	09.10.2013	09.10.2018	22 470 477	109.950		105.140	09.10.	0.375	431.17	Y	
Shizuoka Bank, Ltd., Japan													
0 % Regd.Convertible Bonds 2013-25.4.18 Conv Reg-S	USD	100'000.00	25.04.2013	25.04.2018	21 138 408	99.020	84.758	100.000		0.000	0.000	Y	
Solidium Oy, Helsinki, Finnland													
0 % Regd.Exchangeable Bonds 2014-4.9.18 Conv.on Sampo Plc Shs Reg-S Senior	EUR	100'000.00	04.03.2014	04.09.2018	23 819 862	100.850		100.000		0.000	0.000	Y	
Steinhoff Finance Holding GmbH, Brunn Am Gebirge, Österreich													
1.25 % Convertible Bonds 2015-11.8.22 Conv. on Steinhoff Intl Hldg Reg-S	EUR	100'000.00	11.08.2015	11.08.2022	29 124 232	46.000		100.000	11.02. 11.08.	1.250	666.21 709.53	Y	
STMicroelectronics N.V., Niederlande													
0 % Regd.Convertible Bonds 2014-3.7.19 Conv.Reg-S Tranche A Senior	USD	200'000.00	03.07.2014	03.07.2019	24 806 455	-		100.000	03.07.	0.000	0.000	N	
24.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung													
1 % Convertible Bonds 2014-3.7.21 Conv.Reg-S	USD	200'000.00	03.07.2014	03.07.2021	24 806 458	-		100.000	03.01. 03.07. 10.11.	1.000	1'028.93 963.09 701.83	N	
10.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung													
Suez SA, Paris, Frankreich													
0 % Convertible Bonds 2014-27.2.20 conv. or exch. into Suez shs Reg S	EUR	18.37	27.02.2014	27.02.2020	23 811 997	20.850	93.369	100.000		0.000	0.000	Y	

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** %	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	%	Brutto brut lordo CHF	IUP	HinweisAvertissementNota
TechnipFMC PLC, London, Grossbritannien													
0.875 % Convertible Bonds 2016-25.1.21 Conv.Reg-S	EUR	100'000.00	25.01.2016	25.01.2021	31 236 614	117.950		100.000	25.01. 25.07.	0.875	469.54 484.09	N	
Telenor East Holding II AS, Fornebu, Norwegen													
1/4 % Exchangeable Bonds 2016-20.09.19 Gtd into Shs VimpelCom Sp ADR Reg S	USD	200'000.00	21.09.2016	20.09.2019	33 999 897	105.500		100.000	21.03. 21.09.	0.250	246.32 245.25	N	
Terumo Corporation, Tokyo, Japan													
0 % Zero Coupon Convertible Bonds 2014-6.12.21 Conv.Reg-S	JPY	10'000'000.00	04.12.2014	06.12.2021	26 141 634	139.650	97.422	100.000		0.000	0.000	Y	
Total S.A., Courbevoie, Frankreich													
1/2 % Notes 2015-2.12.22 Conv.	USD	200'000.00	02.12.2015	02.12.2022	30 594 318	102.580	91.354	100.000	02.06. 02.12.	0.500	481.92 492.38	Y	

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017**	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2017			IUP	HinweisAvertissement\Nota
							Em.preis prix d'ém. prezzo di em.	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar.	Datum Date Data		Brutto brut lordo		
						%	%	%		%	CHF		
Unibail-Rodamco SE, Paris, Frankreich													
0% 2014-1.7.21 ORNANE	EUR	288.06	25.06.2014	01.07.2021	24 739 859	352.800	93.165	100.000		0.000	0.000	Y	
0% ORNANE 2015-1.1.22 Convertible into Unibail Rodamco shares	EUR	346.87	15.04.2015	01.01.2022	27 832 563	402.500	98.035	100.000		0.000	0.000	Y	

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017**	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2017			IUP	HinweisAvertissement\Nota
							Em.preis prix d'ém. prezzo di em.	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar.	Datum Date Data		Brutto brut lordo		
						%	%	%		%	CHF		
VEREIT, Inc., New York, USA													
3 % Notes 2013-1.8.18 Sr Conv	USD	1'000.00	29.07.2013	01.08.2018	21 972 750	99.170		100.000	01.02. 01.08.	3.000	14.884 14.484	Y	
Vodafone Group Plc, Newbury, Grossbritannien													
0 % Euro Medium-Term Notes 2015-26.11.20 Conv.	GBP	100'000.00	26.11.2015	26.11.2020	30 528 059	98.450		100.000		0.000	0.000	Y	

Anleihen (Ausland) / Emprunts (Etranger) / Obbligazioni (Estero)

Wandelanleihen / Emprunts convertibles / Obbligazioni convertibili

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 **31.12.2017**	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2017			IUP	HinweisAvertissement\Nota
							Em.preis prix d'ém. prezzo di em.	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar.	Datum Date Data		Brutto brut lordo		
						%	%	%		%	CHF		
Yamada Denki Co., Ltd., Gunma, Japan													
0 % Regd.Convertible Bonds 2014-28.6.19 Conv.Reg-S	JPY	10'000'000.00	12.06.2014	28.06.2019	24 561 860	117.650		100.000		0.000	0.000	Y	

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

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
AB Svensk Exportkredit, Stockholm, Schweden												
(N) ELEMENTS Linked to Rogers Intl Commodities Ind TR	USD	10.00	3 496 611	CHF	5.260				USD			(I)

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

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Bank Bär (Julius) & Co. Ltd., Guernsey												
(N) Certificate 2010-Open End on A.M.&C. Bond Strategy Basket	USD	100.00	12 055 163	CHF	111.860		24.11.		USD			(I)
reine Differenzbesteuerung (N) Actively Managed Certificate 2012-open end on IFS Fixed Income Strategie Basket	CHF	100.00	14 820 692	CHF	118.200		15.02.		CHF		0.000	
(N) Actively Managed-Cert. 2013-open end on basket	CHF	100.00	20 230 294	CHF	92.300				CHF			(I)
(N) Actively Managed-Cert. 2013-open end on basket	USD	100.00	20 230 295	CHF	99.590				USD			(I)
(N) Actively Managed-Cert. 2013-Open End on Evergreen Strategy	EUR	100.00	20 966 647	CHF	162.650		11.10.		EUR			(I)
(N) Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on the Stable Global Grw	USD	100.00	30 689 207	CHF	110.500		15.04.		USD	0.000	0.000	
(N) Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on ITS Global	USD	100.00	33 029 569	CHF	94.520		08.08.		USD	1.345	1.313	
(N) Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on USD Short	USD	99.90	32 836 373	CHF	98.610		01.09.		USD	0.000	0.000	
(N) Underlying Tracker 2016-open end on Basket	USD	1'000.00	34 205 417	CHF	1117.720		02.11.		USD	5.864	5.850	
(N) Underlying Tracker 2016-open end on Basket	USD	1'000.00	34 205 414	CHF	1013.450		02.11.		USD	4.497	4.486	
(N) Underlying Tracker 2016-open end on Basket	USD	1'000.00	34 205 418	CHF	1216.140		02.11.		USD	1.081	1.079	
(N) Underlying Tracker 2016-open end on Basket	USD	100.00	34 480 738	CHF	111.280		21.11.		USD	0.000	0.000	
Banque Cantonale Vaudoise Guernsey Branch, St-Peter Port, Guernsey												
(N) Tracker-Zertifikat 2013-Open End auf Basket	EUR	100.00	20 755 379	CHF	117.090		31.12.		EUR			(I)
(N) Tracker Zertifikat 2013-Open End auf Basket	USD	100.00	20 755 382	CHF	99.860		31.12.		USD			(I)
(N) Tracker Zertifikat 2013-Open End auf Basket	CHF	100.00	20 755 010	CHF	96.790		31.12.		CHF			(I)
(N) Tracker Zertifikat 2013-Open End auf Basket	EUR	100.00	20 755 380	CHF	115.580		31.12.		EUR			(I)
(N) Tracker-Zertifikat 2013-Open End auf Basket	USD	100.00	20 755 381	CHF	101.030		31.12.		USD			(I)
(N) Tracker Zertifikat 2013-Open End auf Basket	CHF	100.00	20 755 006	CHF	97.860		31.12.		CHF			(I)
(N) Tracker Certificate 2013-Open End on Basket	EUR	100.00	21 164 050	CHF	127.110		31.12.		EUR			(I)
(N) Tracker Zertifikat 2013-Open End auf Basket	EUR	100.00	21 164 049	CHF	129.120		31.12.		EUR			(I)
(N) Tracker Certificate 2013-Without Fixed Maturity on a Basket of Funds	EUR	100.00	22 965 726	CHF	123.430		31.12.		EUR			(I)
(N) Tracker Certificate 2013-Without Fixed Maturity on a Basket of Funds	CHF	100.00	22 965 725	CHF	104.800		31.12.		CHF			(I)
(N) Tracker Certificate 2013-Without Fixed Maturity on a Basket of Funds	CHF	100.00	22 965 724	CHF	102.870		31.12.		CHF			(I)
(N) Tracker Certificate 2013-Without Fixed Maturity on a Basket of Funds	EUR	100.00	22 965 727	CHF	125.670		31.12.		EUR			(I)
(N) Dividend Underlying Tracker SumBasket 2014-without fixed maturity on Funds	EUR	1.00	24 766 832	CHF	1288.890		31.12.		EUR			(I)
(N) Underlyng Tracker on a Basket	EUR	100.00	28 613 173		-				EUR			(I)
(N) Underlying Tracker on Funds	CHF	100.00	29 367 273	CHF	103.260		31.12.		CHF			(I)
Barclays Bank PLC, London, Grossbritannien												
(N) Underlying Tracker on S&P 500 VIX STF TR Series A 24.8.2017 Rückkauf ausstehender Titel	USD	102'400.00	37 909 710	CHF	25.900				USD			(I)
(N) Underlying Tracker on S&P 500	USD	2'204.66	26 829 389	CHF	2439.980		07.12.		USD	0.000	0.000	

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

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli		W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
BNP Paribas Issuance B.V., Amsterdam, Niederlande													
Open End Cert 2005-Without fixed maturity on RICIM	(N)	EUR	100.00	2 152 231	CHF	245.410				EUR	0.000	0.000	
Delta One Certificate on JPX Nikkei 400 Index	(N)	EUR	1'000.00	23 213 045		-				EUR			(I)
Transition Certificate VRN on Zurich Insurance Grp AG Shs	(N)	CHF	1'000.00	21 338 318	%	126.860				CHF			(I)
Leveraged Certificate Plus on Euro Stoxx 50 Index	(N)	EUR	1'000.00	27 344 715	CHF	1099.670		28.04.		EUR	0.000	0.000	

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

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Canadian Imperial Bank of Commerce, Toronto, Kanada												
(N) 2.6 % Reverse Convertible 2016-09.03.17 on Equities	CHF	1'000.00	33 840 976		-		09.03.		CHF		0.000	
Credit Suisse AG, Guernsey Branch, St Peter Port, Guernsey												
thesaurierend oder ausschüttend (N) Certificates on PLO III (CH)	EUR	1'000.00	3 097 626	CHF	468.060		31.12.		EUR			(I)
thesaurierend oder ausschüttend (N) Certificates on POLO III (EU)	EUR	1'000.00	3 097 624	CHF	456.350		31.12.		EUR			(I)
Credit Suisse AG, London Branch, London, Grossbritannien												
(N) Quasi-Perpetual Certificates in CHF 2010-open End auf CSCB CHF Hedged Total Return Index	CHF	100.00	11 060 983	CHF	58.920		31.03.		CHF			(I)
(N) Leveraged Return Certificates due 2017 17 Euro Stoxx 50	EUR	1'000.00	12 836 469		-		31.05.		EUR	0.000	0.000	
Credit Suisse AG Nassau Branch, Nassau, Bahamas												
(N) Open-End Tracker Certificates 2014-Without Fixed Maturity on Credit Suisse Risk Idx	GBP	1'000.00	22 556 915	CHF	1364.390		31.03.		GBP			(I)
(N) Underlying Tracker 2015-open end Credit Suisse EAGLE USD Total Return Index	USD	1'000.00	28 845 464	CHF	1247.320		31.03.		USD			(I)
(N) Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	38 487 118	CHF	1089.460				USD	0.000	0.000	
Credit Suisse Core Alternative Strategies Ltd, St Peter Port, Guernsey												
(N) Class USD	USD	100.00	2 847 003	CHF	121.320		31.03.		USD			(I)
(N) Class EUR	EUR	100.00	2 846 999	CHF	138.660		31.03.		EUR			(I)
(N) Class CHF	CHF	100.00	2 846 978	CHF	108.500		31.03.		CHF			(I)
Credit Suisse International, London, Grossbritannien												
(N) Certificates 2011-without fixed maturity on Cr Suisse Risk App Inv Idx	CHF	1'000.00	12 295 726	CHF	1360.000		31.03.		CHF			(I)
(N) Open End Certificates 2011- Without Fixed Maturity on The Credit Suisse RAI Index	EUR	1'000.00	12 295 728	CHF	1597.250		31.03.		EUR			(I)
(N) Open End Certificates 2011-Without Fixed Maturity onCS Risk Appetite InvestableIdx	USD	1'000.00	12 295 724	CHF	1486.070		31.03.		USD			(I)
(N) Open-End Certificates 2012-Without Fixed Maturity on Diversified Bond Fund Index	EUR	1'000.00	18 135 321	CHF	1284.700		31.03.		EUR			(I)
(N) Open End Certificates 2012-Without Fix Maturity on HH Balanced Multi Asset Index	EUR	1'000.00	18 135 323	CHF	1308.810		31.03.		EUR	43.120	46.162	
(N) Open End Certificates 2012-Without Fixed Mat.on MSCI Daily TR Gross World USD Idx	CHF	1'000.00	18 135 322	CHF	727.300		31.03.		CHF			(I)
(N) Open-End Certificates 2012-Without Fixed Maturity on a Basket of Funds	EUR	1'000.00	18 135 325	CHF	1171.670		31.03.		EUR			(I)
(N) Open End Certificates 2013-Without Fixed Maturity on CS ARROW USD TR 6% Index	USD	100'000.00	18 135 338	CHF	105340.740		31.03.		USD			(I)
(N) Open-End Tracker-Cert. 2013-open end on Credit Suisse Family Total Return Index	USD	100'000.00	20 260 565	%	163.320		31.03.		USD			(I)
(N) Open End Certificates 2013-Without Fixed Maturity on CS Arrow EUR Total Return Idx	EUR	1'000.00	18 135 336	CHF	1152.590		31.03.		EUR			(I)
(N) Open-End Certificates 2013-Without Fixed Maturity on CS Arrow USD TR 6% Index	USD	1'000.00	18 135 335	CHF	1028.070		31.03.		USD			(I)
(N) Open-End Certificates 2013-Without fixed maturity on CS Arrow CHF Tr Index	CHF	1'000.00	18 135 337	CHF	965.000		31.03.		CHF			(I)
(N) Tracker-Cert. 2013-open end on CS Family Total Return EUR Index	EUR	100'000.00	20 681 337	%	173.120		31.03.		EUR			(I)

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

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponibile CHF	
(N) Open-End Certificates 2013-Without Fixed Maturity on CS ARROW EUR TR 6% Index	EUR	100'000.00	20 473 153	CHF	119402.100		31.03.		EUR			(I)
(N) Enhanced Income Certificate 2013-Without fixed maturity on a Basket of Index & Fund	EUR	100'000.00	20 473 152	CHF	129886.650		31.03.		EUR			(I)
(N) Open End Certificate 2013-Without Fixed Maturity on GAMSA Global Value Index	CHF	1'000.00	20 473 155	CHF	1194.800		31.03.		CHF			(I)
(N) Open-End Tracker Certificates 2013-Without Fixed Mat. on CS Raiiholt Total Return USD Idx	USD	100'000.00	20 473 151	CHF	128387.080				USD			(I)
(N) Tracker-Cert. 2013-open end on Credit Suisse HOLT EDTR (Net) Index	EUR	10'000.00	20 681 361	%	125.500		31.03.		EUR			(I)
(N) Tracker-Cert. 2013-open end on Credit Suisse Germany Total Return Index	EUR	10'000.00	20 681 362	%	158.750		31.03.		EUR			(I)
(N) Open-End Tracker Certificates 2014-Without fixed maturity on CS Raitholt TR USD Index	USD	1'000.00	20 473 162	CHF	1135.260		31.03.		USD			(I)
(N) Open-End Tracker Certificates 2014-Without fixed maturity on Credit Suisse Index	EUR	10'000.00	20 473 168	CHF	12608.360		31.03.		EUR			(I)
(N) Open-End Tracker Certificates 2014-Without fixed maturity on Credit Suisse Index	USD	1'000.00	20 473 164	CHF	1071.920		31.03.		USD			(I)
(N) Open-End Tracker Certificates 2014-Without fixed maturity on CS RAIIHOLT TR CHF Hedged Idx	CHF	10'000.00	23 717 914	CHF	10700.000		31.03.		CHF			(I)
(N) Constant Leverage Notes 2014-Without fixed maturity on a Bskt of Indices	USD	10'000.00	23 717 919	%	71.750		31.03.		USD			(I)
(N) Tracker-Cert. 2014-open end on Credit Suisse HS60 Europe Index	EUR	1'000.00	20 681 388	CHF	1468.530		31.03.		EUR			(I)
(N) Open End Tracker Certificates 2015-Without fixed maturity on Maple Tree Equity World Ix	EUR	1'000.00	25 775 424	CHF	1223.150		31.03.		EUR			(I)
(N) Open-End Certificates 2015-Without fixed maturity on CS STAA Eur Total Return Ix	EUR	100'000.00	25 775 427	CHF	110286.630		31.03.		EUR			(I)
(N) Certificates 2015-Without Fixed Maturity on Credit Suisse Systematic Idx	USD	100'000.00	25 775 426	CHF	93062.360		31.03.		USD			(I)
(N) Open-End Certificates 2015-Without Fixed Maturity on CS STAA CHF Total Return Ix	CHF	100'000.00	25 775 428	CHF	93000.000				CHF			(I)
(N) Underlying Tracker 2015-open end on Credit Suisse EAGLE CHF Total Return Index	CHF	1'000.00	20 681 402	CHF	1215.000		31.03.		CHF			(I)
(N) Underlying Tracker 2015-open end on Credit Suisse EAGLE Total Return Index USD	USD	1'000.00	20 681 400	CHF	1247.320		31.03.		USD			(I)
(N) Tracker Certificate 2014-without fixed maturity on CS European Periphery 17.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	20 681 370		-		31.03.		EUR			(I)
(N) Dynamic Leverage Notes on a Basket of Funds	EUR	10'000.00	3 250 356		-				EUR			(I)
(N) Notes on CS Global Carry Selector Index	EUR	260'000.00	19 982 832		-				EUR			(I)
(N) Tracker Certificates (21.5.18) on CS Systematic Tractical Asset TR Ix	USD	100'000.00	25 775 437	CHF	94913.860		31.03.		USD			(I)
Custom Markets Securities 2 Plc, Dublin, Irland												
(N) Underlying Tracker on CS Alternative Access 2017	USD	10'000.00	36 447 010	CHF	9793.470		31.03.		USD	0.000	0.000	

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

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017					
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Deutsche Bank AG, Frankfurt am Main, Deutschland											
(N) X-Pert-Zert. 2003-ohne festen Verfall auf Hang Seng China Enterpr.-Index	EUR	0.000	1 746 611	CHF	373.590				EUR	0.000	0.000
(N) Reverse Convertible auf S&P 500	USD	0.000	14 188 208	CHF	100.560		18.05.		USD	0.000	0.000
DWS GO SA, Luxemburg											
(N) Open End Cert. 2006-open end on the Vietnam Total Return Index	EUR	50.00	2 849 962	CHF	134.550				EUR	0.000	0.000
DZ BANK AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank, Frankfurt A/Main, Deutschland											
(N) 4 % ZinsFix Control auf N.-Akt. Allianz	EUR	1'000.00	30 528 486		-		13.01.		EUR	0.000	0.000
(N) 4 % ZinsFix Control auf N.-Akt. BASF	EUR	1'000.00	24 784 950		-		07.07.		EUR	0.000	0.000

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

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli		WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
EFG International Finance (Guernsey) Limited, Guernsey													
Tracker-Cert. 2012-open end on Greek Opportunities Index	(N)	EUR	1'000.00	19 271 352	CHF	801.780		06.11.		EUR			(I)
Tracker-Cert. 2013-open end on GAIA Farming 20 Index 30.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	(N)	USD	1'000.00	19 538 556		-		14.02.		USD	0.000	0.000	
Managed Certificate on Derivative Investment Products	(N)	USD	1'000.00	18 737 331		-				USD			(I)
Investment-Cert. on DIPS I	(N)	USD	1'000.00	19 089 269		-				USD			(I)
Investment-Cert. DIPS I	(N)	USD	1'000.00	19 089 496		-				USD			(I)
Investment-Cert. on DIPS I	(N)	USD	1'000.00	19 271 450		-				USD			(I)
Tracker-Cert. on Galaad Equities Strategy	(N)	USD	1'000.00	19 538 676		-				USD			(I)
Tracker-Cert. on Performance ValueStrategy	(N)	EUR	1'000.00	19 538 880		-				EUR			(I)
Tracker-Cert. on Managed CHF Funds Strategy	(N)	CHF	1'000.00	19 538 640	%	93.300				CHF			(I)
Tracker-Cert. on Managed EUR Funds Strategy	(N)	EUR	1'000.00	19 538 639	%	96.000				EUR			(I)
ETFS Commodity Securities Ltd, St Helier, Jersey													
Regd.Commodity Securities 2006-Without Fixed Maturity on Blmbrg Agri Sublx Secured	(N)	USD	2.83	2 726 117	CHF	4.510				USD			(I)
ETFS Metal Securities Ltd, St Helier, Jersey													
Regd.Certificates 2007-Without Fixed Maturity On Platinum Secured	(N)	USD	132.10	3 068 386	CHF	86.200		24.04.		USD			(I)
Regd.Notes 2007-Without Fixed Maturity on Gold Commodity Secured	(N)	USD	50.00	3 068 233	CHF	121.340				USD	0.000	0.000	
Zert. 2007-o.f. Verfall auf Gold	(N)	USD	68.84	3 139 322	CHF	121.420		08.05.		USD			(I)
Exane Finance, Paris, Frankreich													
Underlying Tracker 2017-without fixed maturity on EXDMECMH	(N)	EUR	1'000.00	35 615 760	%	104.310				EUR			(I)
Rythmic Index Certificate on Rythmic Index	(N)	USD	1'000.00	24 950 658		-				USD			(I)

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

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Goldman Sachs International, London, Grossbritannien												
(N) Regd.Tracker Certificate 2015-Without Fixed Maturity on GS Risk Premia Basket Index	USD	1'000.00	29 170 047	CHF	1022.900				USD			(I)

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

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
HSBC Bank PLC, London, Grossbritannien												
(N) Reshuffle Compo Bull Notes on a Basket of Shs Senior	CHF	1'000.00	22 524 033	CHF	1288.510		31.12.		CHF			(I)
(N) Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	33 014 771	CHF	1031.660		10.02.		CHF		0.000	
(N) Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	CHF	1'000.00	36 244 351	CHF	966.980		21.12.		CHF		0.000	

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

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli		W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
J.P.Morgan Structured Products B.V., Amsterdam, Niederlande													
Regd.Certificate on Rheinberg Multi Asset Index	(N)	CHF	1'000.00	22 621 339	CHF	1063.230		30.10.		CHF			(I)
Reverse Convertible on STOXX Glb SD 100	(N)	USD	1'000.00	34 750 778	CHF	992.540				USD			(I)
Underlying Tracker on SMI	(N)	USD	1'000.00	34 750 805	CHF	954.900				USD	0.000	0.000	

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

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli		WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Lang & Schwarz Aktiengesellschaft, Düsseldorf, Deutschland													
Index-Zert. 2013-o.f. Verfall auf Mid. Term. Alpha Index	(N)	EUR	122.81	20 670 392	CHF	431.420		11.02.		EUR			(I)
Zert. 2014-o.f. Verfall auf Wikifolio-Indizes	(N)	EUR	119.84	23 815 737	CHF	224.340				EUR			(I)
Index-Zert. 2015-o.f. Verfall auf Wikifolio-Indizes	(N)	EUR	119.44	28 825 769	CHF	360.080		08.07.		EUR			(I)
Leonteq Securities AG, Guernsey Branch, Guernsey													
Tracker-Cert. 2012-open end on Dynamic Real Income Index	(N)	USD	1'000.00	19 903 771	CHF	1226.440		09.11.		USD			(I)
Tracker-Cert. 2012-open end on Dynamic Real Income Index	(N)	EUR	1'000.00	19 903 849	CHF	1448.130		21.11.		EUR			(I)
Investment-Cert. on DIPS I	(N)	USD	1'000.00	19 538 344		-				USD			(I)
Investment-Cert. on Basket	(N)	USD	1'000.00	20 516 588	%	47.650		01.02.		USD			(I)
Investment-Cert. on Basket	(N)	USD	1'000.00	20 802 243	%	1.000		15.03.		USD			(I)
Investment-Cert. on Basket	(N)	USD	1'000.00	20 802 244	%	1.000		15.03.		USD			(I)

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

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli	WMV	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017					
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Portfolio Solutions SA, Luxemburg											
(N) Cert. 2010-open end on LGT GIM Growth (EUR) B	EUR	1.00	11 216 346	CHF	16915.770		31.12.		EUR	220.08	257.52
(N) Cert. 2010-open end on the GIM Balanced (EUR) B	EUR	1.00	11 216 344	CHF	15416.640		31.12.		EUR	216.82	253.71
(N) Cert. 2010-open end on LGT Strategy 2 Years (EUR) B	EUR	1.00	11 216 348	CHF	1959.730		31.12.		EUR	28.434	33.272
(N) Cert. 2010-open end on LGT CF Premium Strategy GIM Tranche IV	EUR	0.000	11 615 896	CHF	1533.590		31.12.		EUR	1.950	2.281
(N) Strategy-Cert. 2010-open end on LGT STRAT 4 EUR	EUR	0.000	11 595 372	CHF	1990.510		31.12.		EUR	17.650	20.653
(N) Strategy-Cert. 2010-open end on LGT STRAT 3 EUR	EUR	0.000	11 594 700	CHF	2009.240		31.12.		EUR	18.391	21.520
(N) Cert. 2011-open end on LGT Class Fund Premium Strategy GIM (CHF)	CHF	0.000	13 416 793	CHF	1151.620		31.12.		CHF		2.127
(N) Cert. 2011-open end on LGT Class Fund Premium Strategy GIM (USD)	USD	0.000	13 416 283	CHF	1246.650		31.12.		USD	2.311	2.252
(N) Cert. 2015-open end on LGT Premium Strategy GIM(USD)	USD	0.000	26 779 119	CHF	1251.230		31.12.		USD	2.311	2.252
(N) Cert. 2015-open end on LGT Premium Strategy GIM(EUR)	EUR	0.000	26 779 084	CHF	1539.530		31.12.		EUR	1.950	2.281
(N) Cert. 2015-open end on LGT Premium Strategy GIM(CHF)	CHF	0.000	26 779 086	CHF	1155.210		31.12.		CHF		2.127
(N) Underlying Tracker 2017-open end on LGTCHPrSt -(EUR) B-	EUR	0.000	36 307 193	CHF	1181.330				EUR		(I)

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

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Special Solutions SA, Luxemburg												
(N) Participation Notes 2013-open end on LGT Select EQ EM IM	USD	0.000	22 842 123	CHF	1243.590				USD			(I)
Star Compass PLC, Dublin, Irland												
(N) Regd.Extendable Index linked Notes on UBS Stable Alpha Index Series 18	CHF	1'000.00	21 698 771	%	98.930		01.01.		CHF			(I)
(N) Regd.Extendable Notes on Key Multi-Manager Hedge-Diversified S16 Sec	USD	1.00	21 698 704	%	133.810		01.01.		USD			(I)
(N) Regd.Extendable Notes on Key Multi-Manager Hedge Fd - Focused Secured	USD	1.00	21 698 747	%	124.670		01.01.		USD			(I)
(N) Regd.Extendable Index linked Notes on UBS Stable Alpha Index Srs 20 Secured	USD	1'000.00	22 397 107	%	104.030		01.01.		USD			(I)

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

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
UBS AG, Jersey Branch, St Helier, Jersey												
(N) Underlying Tracker on Basket	USD	100.00	33 704 710		-		02.02.		USD	0.1154	0.11416	
(N) Tracker Certificate 2010-open end on UBS DSI EUR Total Return Index 31.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	0.000	11 318 117		-		01.01.		EUR			(I)
(N) Exchange Traded Access Secs 2008-05.4.38 Ser -A- Lnk to UBS Bloomberg CMCI Energy Idx TR	USD	25.00	3 922 351	CHF	7.820				USD			(I)
UBS AG, London Branch, London, Grossbritannien												
(N) Certificates 2006-Without fixed Maturity On GPR Germany TR Index 30.6.2017 Vorz. Rückzahlung	EUR	102.00	2 665 330		-		05.09.		EUR			(I)
(N) Strategy Certificate 2008- Open End on V10 CCY Strategy Total Return Index	USD	10'000.00	3 821 551	CHF	9762.920		01.01.		USD			(I)
(N) PERLES 2012-open end on ULTARADA on Euro Stoxx 50-Index	EUR	90.55	18 819 526	CHF	129.880		01.01.		EUR	1.580	1.688	
(N) Perles 2012-Open End on UBS Sel. High Yield Bond Fund Rot.Index	USD	250.67	18 905 148	CHF	298.280		01.01.		USD			(I)
(N) Perles 2012-Open End on UBS Constant Maturity Dividend Index (EUR)	EUR	120.64	19 158 995	CHF	185.230		01.01.		EUR			(I)
(N) Underlying Tracker 2015-Open End on MSCI Daily TR Gross USA Index	USD	80.60	28 598 024	CHF	105.820				USD			(I)
(N) Zertifikat auf Climate Change Strategy	EUR	1'000.00	2 896 022		-				EUR			(I)
(N) Zertifikat auf Climate Change Strategy	USD	1'000.00	2 896 023		-				USD			(I)
(N) Zertifkat auf Climate Change Strategy	CHF	1'000.00	2 896 018		-				CHF			(I)
(N) Zertifikat auf Top Pick Strategy	CHF	100.00	3 027 082		-		11.01. 11.05.		CHF CHF		1.362 1.443	
(N) Underlying Tracker on Indices 22.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	100.00	34 707 019		-		22.02.		USD	0.24605	0.24894	
(N) Underlying Tracker on Indices 22.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	100.00	34 707 021		-		22.02.		EUR	0.1022	0.10902	
(N) Underlying Tracker on Indices 22.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	100.00	34 707 023		-		22.02.		CHF		0.1022	
(N) Underlying Tracker on Indices 22.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	100.00	34 707 022		-		22.02.		CHF		0.1022	
(N) Underlying Tracker on Indices 22.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	100.00	34 707 018		-		22.02.		USD	0.24605	0.24894	
(N) Underlying Tracker on Indices 22.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	100.00	34 707 020		-		22.02.		EUR	0.1022	0.10902	
(N) Underlying Tracker 15.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	100.00	34 848 253		-		15.05.		CHF		0.16979	
(N) Underlying Tracker 15.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	100.00	34 848 251		-		15.05.		EUR	0.16979	0.18577	
(N) Underlying Tracker 15.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	100.00	34 848 252		-		15.05.		EUR	0.03843	0.04204	
(N) Underlying Tracker 15.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	100.00	34 848 254		-		15.05.		CHF		0.03843	
(N) Underlying Tracker 15.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	100.00	34 848 250		-		15.05.		USD	0.38555	0.38425	

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

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017					
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
(N) Underlying Tracker 15.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	100.00	34 848 249		-		15.05.		USD	0.51691	0.51516
(N) Zertifikat auf Water Strategy	USD	1'000.00	3 135 881		-		01.01. 26.06.		USD USD	5.693 2.576	5.858 2.499
(N) Zertifikat auf Water Strategy	EUR	1'000.00	3 135 879		-		01.01. 26.06.		EUR EUR	1.446 3.045	1.545 3.310
(N) Zertifikat auf Water Strategy	CHF	1'000.00	3 135 877		-		01.01.		CHF		1.055
(N) Strategy Certificates on Balius Strategy Ref Portfolio	USD	100.00	18 868 755		-		01.01.		USD	0.000	0.000
(N) Strategy Certificates on Future Energies (USD) Reference-Portfolio	USD	1'000.00	3 271 711		-		01.01.		USD	1.340	1.379
(N) Underlying Tracker on Basket	EUR	100.00	31 618 970		-		06.10.		EUR	6.862	7.875
(N) Underlying Tracker on Basket	GBP	100.00	31 618 972		-		06.06.		GBP	6.997	11.778
(N) Underlying Tracker on Basket	USD	100.00	31 618 968		-		06.10.		USD	8.707	8.516
(N) Underlying Tracker on Basket	SGD	100.00	31 618 973		-		06.10.		SGD	8.152	5.839
(N) Underlying Tracker on Basket	CHF	100.00	31 618 971		-		06.10.		CHF		7.206
(N) Startegy Certificates on a Reference Portfolio	CHF	100.00	19 819 645		-		01.01.		CHF		2.026
(N) Strategy Certificate on GETI Reference Portfolio	EUR	100.00	19 819 644		-		01.01.		EUR	2.148	2.295
(N) Underlying Tracker on Equities Series 15134	USD	1'000.00	34 217 343		-				USD		(I)
(N) Strategy Certificates on Pheonix Financials USD Reference-Portfolio 31.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	3 816 548	CHF	-		01.01.		USD	4.175	4.296
(N) Performance Linked Notes on basket	USD	10'000.00	21 236 749	CHF	11933.630		07.03. 02.06. 05.09. 05.12.		USD USD USD USD	20.000 80.669 91.320 76.660	20.269 77.754 87.298 75.691
(N) Underlying Tracker 2016-02.01.19 on ACWI	EUR	1'000.00	34 922 140	CHF	1282.210				EUR	0.000	0.000
(N) Performance Linked Notes on Basket	JPY	1'000'000.00	23 154 596	CHF	12035.080				JPY		(I)
(N) Performance Linked Notes on Basket	USD	10'000.00	23 154 594	CHF	13324.890				USD		(I)
(N) Strategy Certificates on Global High Div Ref Portfolio	USD	100.00	20 838 312	CHF	102.620		21.06.		USD	1.810	1.764
(N) Underlying Tracker on UBS Wealth Management Global Property Fund	CHF	6.85	34 755 700	CHF	3.010				CHF		(I)
(N) Zertifikat auf A&Q Alternative Solution Index	EUR	1'000.00	2 468 599	CHF	1428.580		01.01.		EUR		(I)
(N) Zertifikat auf A&Q Alternative Solution Index	CHF	1'000.00	2 468 590	CHF	1158.400		01.01.		CHF		(I)
(N) Zertifikat auf A&Q Alternative Solution Index	USD	1'000.00	2 468 533	CHF	1345.100		01.01.		USD		(I)
(N) Strategy Certificates on LGT Aktien Schweiz Portfolio	CHF	1'000.00	23 103 416	CHF	1243.060		01.01.		CHF		(I)
(N) Strategy Certificates on LGT FI Ref Portfolio	EUR	1'000.00	23 923 943	CHF	1174.900		01.01.		EUR		(I)
(N) Strategy Certificates on LGT FI Ref Portfolio	CHF	1'000.00	23 923 942	CHF	955.290		01.01.		CHF		(I)
(N) Strategy Certificates on LGT FI Ref Portfolio	USD	1'000.00	23 923 944	CHF	1009.830		01.01.		USD		(I)
(N) Exchange Traded Access Securities Ser -A- Lkd to Wells Fargo Business Developm Co	USD	25.00	13 091 232	CHF	16.150		24.01. 21.04. 24.07. 23.10.		USD USD USD USD	0.7393 0.7728 0.8137 0.7127	0.73857 0.77182 0.76977 0.70262
UBS Europe SE, Frankfurt, Deutschland											
(N) Global Property Index Zertifikat	EUR	100.00	2 164 734		-		31.01.		EUR		(I)

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

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli	W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
						Datum / Date Data		Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
						ex. (E)	zahlb. pay. pag.					
Vontobel Financial Products Ltd, Vereinigte Arabische Emirate												
(N) Active Dynamic Voncert 2007- open end on Global Opportunity Basket	CHF	100.00	3 102 918	CHF	128.800		18.05.		CHF			(I)
(N) Active Dynamic Voncert 2009-open End on a Energy-Equity Basket	CAD	1'000.00	10 689 555	CHF	775.780				CAD			(I)
(N) Underlying Tracker 2015-without fixed maturity on Basket	EUR	100.60	24 173 147	CHF	115.490				EUR			(I)
(N) Underlying Tracker 2015-without fixed maturity on Basket	CHF	100.30	24 173 173	CHF	159.500				CHF			(I)
(N) Underlying Tracker 2015-open end on Swiss Made Equity	CHF	100.00	24 173 559	CHF	150.400				CHF			(I)
(N) Underlying Tracker 2015-without fixed maturity on Basket	EUR	100.00	24 173 562	CHF	123.560				EUR			(I)
(N) Underlying Tracker 2015-open end on Optimized Opportunity Referenzportfolio	EUR	100.00	29 258 604	CHF	145.680				EUR			(I)
(N) Underlying Tracker 2015-open end on "Balanced EUR" Reference Portfolio	EUR	101.50	30 187 279	CHF	117.170				EUR			(I)
(N) Underlying Tracker 2015-open end on Japan Equity reference portfol io	EUR	102.00	30 187 616	CHF	142.790				EUR			(I)
(N) Underlying Tracker 2015-open end on Funds	CHF	101.15	24 173 390		n.v.		30.12.		CHF			(I)
(N) Underlying Tracker 2015-o.f. Verfall auf USD Bonds - Referenzportfolio	USD	100.25	30 188 055	CHF	106.620				USD			(I)
(N) Underlying Tracker 2016-open end on Avanti World Reference Portfol io	USD	100.00	31 613 035	CHF	113.910		30.12.		USD			(I)
(N) Underlying Tracker 2016-open end on Global Flexible Equity Strategy	EUR	100.50	31 613 818	CHF	132.570		30.12.		EUR			(I)
(N) Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on "Mega Trends"	USD	100.00	31 613 649	CHF	138.470		30.12.		USD			(I)
(N) Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on Fixed Income Value Strat	EUR	100.25	31 614 620	CHF	122.390		30.12.		EUR			(I)
(N) Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on Emerging Markets	USD	1'000.00	32 149 416	CHF	1128.440		30.12.		USD			(I)
(N) Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on Asymmetric Credit T R	USD	100.00	32 149 660	CHF	105.820		30.12.		USD			(I)
(N) Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on Q Value portfolio	USD	10'000.00	32 149 538	CHF	13254.020		30.12.		USD			(I)
(N) Underlying Tracker 2016- open end on High Dividends Stocks	EUR	1'010.00	32 759 195	CHF	1393.990		30.12.		EUR			(I)
(N) Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on Aktiv Balanced Strategie	CHF	100.00	32 149 374	CHF	109.400		30.12.		CHF			(I)
(N) Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on EM Short Duration	USD	1'000.00	33 460 100	CHF	999.810		30.12.		USD			(I)
(N) Underlying Tracker 2016-open end on Basket	USD	100.00	33 460 250	CHF	120.050		30.12.		USD			(I)
(N) Underlying Tracker 2016-open end on Am Strategic Leaders Referenzportfolio	USD	100.60	34 182 619	CHF	120.640		30.12.		USD			(I)
(N) Underlying Tracker 2016-Open end on BCC High Yield EUR Reference Portfolio	EUR	100.00	34 183 001	CHF	122.860		30.12.		EUR			(I)
(N) Underlying Tracker 2016-Open end on BCC High Yield USD Reference Portfolio	USD	100.00	34 183 000	CHF	98.900		30.12.		USD			(I)
(N) Reverse Convertible on Equities	CHF	781.25	30 938 429		-		19.01.		CHF		0.000	
(N) Underlying Tracker 2015-without fixed maturity on Basket 17.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'006.00	24 173 516		-				EUR			(I)
(N) Reverse Convertible on Roche Hldg G	CHF	216.70	34 183 415		-				CHF			(I)

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

Anlagefondsähnliche Vermögen / Ensemble de biens assimilés à un fonds de placement / Patrimoni simili ai fondi d'investimento comuni

Titel / Titres / Titoli		W M V	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF/%		Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Underlying Tracker on Basket	(N)	USD	100.25	34 183 482	CHF	114.500				USD			(I)
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	(N)	EUR	3'604.55	38 290 806	CHF	3975.250				EUR	0.000	0.000	
Underlying Tracker on Funds	(N)	EUR	104.90	34 181 757	CHF	102.970				EUR			(I)

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

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	WMV	Laufzeit Durée Durata		Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Bank Bär (Julius) & Co. Ltd., Guernsey													
Actively Managed Certificate 2011-Open End on A.M.&C. EUR Bond Strategy	EUR	25.03.2011		100.00	12 689 404	130.700		18.03.		EUR			(I)
Banque Cantonale Vaudoise Guernsey Branch, St-Peter Port, Guernsey													
Certificat Tracker 2013-without fixed maturity on NASDAQ 100	USD	15.04.2013		140.31	21 089 046	313.050		15.04.		USD			(I)
Underlying Tracker 2015-open end on Basket	USD	08.12.2015		5'000.00	30 166 530	110.190		31.12.		USD			(I)
Barclays Bank PLC, London, Grossbritannien													
iPath Bloomberg Copper Subindex Total Return ETN Ser -A- Linked Bloomberg Copper Subindex TR	USD	23.10.2007	22.10.2037	0.000	3 327 359	36.580		23.10.		USD			(I)
BNP Paribas Issuance B.V., Amsterdam, Niederlande													
Perpetual Zertifikat auf Dax Index	EUR	28.08.2000		0.000	1 119 712	151.330		28.08.		EUR			(I)
Perpetual Zertifikat auf Nasdaq 100 Index	EUR	28.08.2000		0.000	1 119 698	62.750		28.08.		EUR			(I)
Perpetual Zertifikat auf Dow Jones Euro Stoxx 50 Index	EUR	28.08.2000		0.000	1 119 697	41.150		28.08.		EUR			(I)
Perpetual Zertifikat auf Dow Jones Industrial Average Index	EUR	28.08.2000		0.000	1 119 696	242.290		28.08.		EUR			(I)
Perpetual Zertifikat auf S&P 500 Index	EUR	17.10.2000		0.000	1 137 071	262.670		17.10.		EUR			(I)
Perpetual Zertifikat auf Dow Jones Stoxx Food & Beverage Index	EUR	25.01.2001		0.000	1 179 712	80.040		25.01.		EUR			(I)
Perpetual Zertifikat auf Dow Jones Stoxx Healthcare Index	EUR	25.01.2001		0.000	1 179 713	77.590		25.01.		EUR			(I)
Perpetual-Cert. 2001-without final maturity DJ STOXX Insurance Index-linked	EUR	25.01.2001		34.43	1 179 127	34.270		25.01.		EUR	0.000	0.000	
Perpetual-Cert. 2001-without final maturity AMEX Biotechnology-Index-linked	EUR	22.02.2001		64.32	1 193 069	414.300				EUR			(I)
Open End Zertifikat auf Amex Pharmceutical Index	EUR	02.07.2001		0.000	1 254 469	53.380		02.07.		EUR			(I)
Zertifikat auf Amex Gold Bugs Index	USD	15.08.2002		0.000	1 462 937	185.240				USD			(I)
Zertifikat auf Gold Price Index	USD	15.08.2002		0.000	1 462 936	126.480		15.08.		USD			(I)
Zertifikat auf Dow Jones Industrial Average	USD	19.08.2002		0.000	1 468 666	241.470		19.08.		USD			(I)
Open End Zertifikat auf Amex Pharmaceutical Index	USD	19.08.2002		0.000	1 468 679	52.760		19.08.		USD	0.000	0.000	
Zertifikat auf Amex Oil Index	USD	19.08.2002		0.000	1 468 647	129.800				USD			(I)
Zertifikat auf Amex Biotechnology Index	USD	19.08.2002		0.000	1 468 726	413.170		19.08.		USD			(I)
Zertifikat auf Amex Natural Gas Index	USD	19.08.2002		0.000	1 468 712	50.380				USD			(I)
Zertifikat auf Swiss Market Index [SMI]	CHF	19.08.2002		0.000	1 468 703	93.800		19.08.		CHF			(I)
Cert 2003-without fixed maturity on the platinum spot	EUR	12.03.2003		6.40	1 572 326	9.040		12.03.		EUR			(I)
Zertifikat auf Platinum Spot Price	USD	03.02.2004		0.000	1 781 994	9.030				USD			(I)
Zertifikat auf Silver Spot Price	USD	03.02.2004		0.000	1 782 007	16.460		03.02.		USD			(I)
Zertifikat auf Palladium Spot Price	USD	03.02.2004		0.000	1 781 988	10.230		03.02.		USD			(I)
Open End Cert 2004-Without fixed maturity on Hang Seng Index	USD	06.02.2004		1.75	1 776 060	3.660		06.02.		USD			(I)
Open End Zertifikat auf Russian Depository Index	USD	05.05.2004		0.000	1 853 001	1.330		05.05.		USD			(I)
Zertifikat auf MSCI Taiwan Index	USD	28.06.2004		0.000	1 890 728	1.250		28.06.		USD			(I)
Zertifikat auf Brazil Top 15 Basket	USD	26.07.2004		0.000	1 909 465	110.400		26.07.		USD	0.000	0.000	
Zertifikat auf FTSE/ASE 20 Index	EUR	13.08.2004		0.000	1 925 318	2.300		13.08.		EUR	0.000	0.000	
Open End Zertifikat auf Dow Jones Turkey Titans 20 Index	USD	29.10.2004		0.000	1 983 529	4.940		29.10.		USD			(I)
Zertifikat auf NXMEX Henry Hub Natural Gas Index	USD	10.12.2004		0.000	2 015 782	0.020		10.12.		USD			(I)
Open End Zertifikat auf NYMEX Unleaded Gasoline Future	USD	07.01.2005		0.000	2 035 969	13.390		07.01.		USD			(I)
Open End Zertifikat auf NYMEX Heating Oil Future	USD	07.01.2005		0.000	2 035 978	7.950		07.01.		USD			(I)
Open End Cert 2005-Without fixed mat.on AAB BRIC Basket ADR/GDR Ind 14.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	26.01.2005		100.00	2 050 409	-		26.01.		EUR			(I)
Open End Zertifikat auf ABN AMRO-BRIC Basket	USD	14.02.2005		0.000	2 065 668	213.500		14.02.		USD			(I)

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

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	W M V	Laufzeit Durée Durata		Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data		Cp.	W M V	Brutto Brut lordo	zu versteuernder Ertrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
							ex. (E)	zahlb. pay. pag.			Fr.W.		
Open End Zertifikat auf den Gas Oil Future	USD	22.03.2005		0.000	2 097 369	3.130		22.03.		USD			(I)
Open End Zertifikat auf Dow Jones Eurostoxx 50 Index	EUR	04.04.2005		0.000	2 106 958	4.100		04.04.		EUR			(I)
Open End Zertifikat auf Bovespa Index	USD	14.04.2005		0.000	2 117 536	22.160		14.04.		USD			(I)
Open End Cert 2005-Without fixed maturity on Rogers Int MetalsComm Index	USD	29.04.2005		100.00	2 127 153	170.530		29.04.		USD	0.000	0.000	
Open End Zertifikat auf Total Return Water Index	USD	17.08.2005		0.000	2 171 179	293.560		17.08.		USD	0.000	0.000	
Open End Zertifikat auf Total Return Water Index	EUR	17.08.2005		0.000	2 228 431	364.790		17.08.		EUR			(I)
Open End Zertifikat auf Total Return Water Index	CHF	17.08.2005		0.000	2 205 578	235.600		17.08.		CHF			(I)
Open End Zertifikat auf Cairo & Alexandria Stock Exchanges CASE 30 Index	USD	27.10.2005		0.000	2 315 807	8.010		27.10.		USD			(I)
Open End Zertifikat auf S&P Custom/ ABN AMRO Total Return Water Stocks Index (USD)	USD	31.10.2005		0.000	2 301 350	322.060		31.10.		USD			(I)
Open End Zertifikat auf S&P Custom/ ABN AMRO Total Return Water Stocks Index (EUR)	EUR	31.10.2005		0.000	2 301 362	386.730		31.10.		EUR	0.000	0.000	
Open End Zertifikat auf S&P Custom/ ABN AMRO Total Return Water Stock Index (CHF)	CHF	31.10.2005		0.000	2 301 380	250.750		31.10.		CHF		0.000	
Open End Zertifikat auf KFX OMX Copenhagen 20 Index	EUR	09.01.2006		0.000	2 387 289	160.770				EUR			(I)
Open End Zertifikat auf S&P Custom Metal & Mining Index	CHF	10.02.2006		0.000	2 401 843	69.500		10.02.		CHF			(I)
Open End Zertifikat auf S&P Custom Metal & Mining Index	USD	10.02.2006		0.000	2 401 823	91.400		10.02.		USD			(I)
Open End Zertifikat auf Mexican Bolsa Index	USD	15.02.2006		0.000	2 440 891	24.160		15.02.		USD			(I)
Open End Zertifikat auf CECE Composite Index	EUR	07.03.2006		0.000	2 467 038	22.170				EUR			(I)
Open End Zertifikat auf Money Market Super Yield Index	EUR	14.03.2006		0.000	2 432 372	147.200		14.03.		EUR	0.000	0.000	
Open End Cert 2006-Without fixed maturity on ABN AMRO Natural Gas Index	USD	04.05.2006		100.00	2 521 821	128.140		04.05.		USD			(I)
Open End Cert 2006-Without fixed maturity on ABN AMRO Natural Gas Index	CHF	04.05.2006		100.00	2 521 827	103.500		04.05.		CHF			(I)
Zertifikat auf LPX Private Equity	CHF	17.05.2006		0.000	2 534 566	100.500		17.05.		CHF			(I)
Open End Zertifikat auf SMIM Index	CHF	30.10.2006		0.000	2 763 910	25.750		30.10.		CHF			(I)
Open End Zertifikat auf Solar Energy TR Index	EUR	15.01.2007		0.000	2 864 664	22.700		15.01.		EUR			(I)
Open End Zertifikat auf Solar Energy TR Index	USD	15.01.2007		0.000	2 864 555	17.540		15.01.		USD			(I)
Open End Zertifikat auf Oil & Gas Services Index	USD	29.03.2007		0.000	3 015 226	76.350		29.03.		USD			(I)
Open End Zertifikat auf Vietnam Index	USD	04.04.2007		0.000	3 026 366	41.800		04.04.		USD			(I)
Open End Zertifikat auf Vietnam Index	CHF	04.04.2007		0.000	3 026 392	34.400		04.04.		CHF			(I)
Certifikat auf Africa Resources Index	USD	12.04.2007		0.000	3 039 320	113.720		12.04.		USD			(I)
Underlying Tracker 2015-Open End on THEAM Quant Equity Europe Guru	EUR	25.02.2015		100.00	26 833 818	127.190				EUR			(I)
Underlying Tracker 2015-Open End on THEAM Quant Equity Europe Guru	CHF	09.03.2015		100.00	27 208 539	113.800				CHF			(I)
Underlying Tracker 2015-Open End on THEAM Quant Equity US Guru	CHF	09.03.2015		100.00	27 208 538	118.100				CHF			(I)
Tracker Certificate 2015-open end on Solactive Home Automation	CHF	31.07.2015		101.50	28 374 633	166.100		31.07.		CHF			(I)
Tracker-Cert. 2015-open end on Ethical Europe Climate	USD	23.11.2015		100.00	30 052 308	106.410				USD			(I)
Tracker-Cert. 2015-open end on Ethical Europe Climate	EUR	23.11.2015		100.00	30 052 307	114.730				EUR			(I)
Underlying Tracker on Equities	EUR	28.01.2016	27.01.2017	1'000.00	30 744 126	-				EUR			(I)
Underlying Tracker on Equities	CHF	28.01.2016	27.01.2017	1'000.00	30 744 127	-				CHF			(I)
Underlying Tracker on Equities	USD	28.01.2016	27.01.2017	1'000.00	30 744 128	-				USD			(I)
Tracker Certificate on a Basket of Shs & ADR	USD	28.02.2014	28.02.2017	1'000.00	23 213 294	-				USD			(I)
Delta One Certificate on JPX-NIKKEI 400 Index	USD	08.08.2014	08.08.2017	1'000.00	23 214 786	-				USD			(I)
Underlying Tracker on Equities	USD	30.12.2016	29.12.2017	1'000.00	31 998 143	-				USD			(I)

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

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	WMV	Laufzeit Durée Durata		Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
3 3/4 % Underlying Tracker on iSTOXX ENDLR EUR	USD	15.05.2015	15.05.2018	1'000.00	27 788 659	89.450		15.05.		USD	37.395	37.269	
3 1/4 % Underlying Tracker on iSTOXX ENDLR EUR	EUR	15.05.2015	15.05.2018	1'000.00	27 788 657	89.600		15.05.		EUR	32.409	35.461	
2 1/4 % Underlying Tracker on iSTOXX ENDLR EUR	CHF	15.05.2015	15.05.2018	1'000.00	27 788 658	88.850		15.05.		CHF		22.437	
BNP Paribas Issuance B.V., Grossbritannien													
Open End Zertifikat auf Dax Index	EUR	04.04.2005		0.000	2 106 951	14.910		04.04.		EUR			(I)

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

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	WMV	Laufzeit / Durée / Durata		Nominell / Valeur nominale / Valore nominale	Valoren-Nr. / No de valeur / Numero di valore	Steuerwert / Val. imposable / Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto / Brut / lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Commerzbank AG, Frankfurt am Main, Deutschland													
Zert. 2000-ohne festen Verfall NIKKEI 225-Index-linked	EUR	22.09.2000		16.06	1 130 025	26.640		22.09.		EUR	0.000	0.000	
Index-Zert. 2001-ohne festen Verfall auf S&P MIB 40-Index	EUR	02.02.2001		44.60	1 187 968	26.030		02.02.		EUR	0.000	0.000	
Faktor 4x Short-Zert. 2010-o.f. Verfall auf Faktor 4x Short DAXF Index 30.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	23.08.2010		10.00	11 617 870	-				EUR			(I)
Factor-Zert. 2011-o.f. Verfall auf Faktor Single Short VSTOXXF Index	EUR	03.06.2011		100.00	13 098 366	256.530		03.06.		EUR	0.000	0.000	
Factor-Zert. 2011-o.f. Verfall auf Faktor Double Short VIXF Index 6.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	30.06.2011		0.000	13 098 363	-		30.06.		EUR	0.000	0.000	
Faktor-Zert. 2013-o.f. Verfall auf Volatility Index Future	EUR	02.09.2013		0.000	21 908 652	0.001		02.09.		EUR	0.000	0.000	
Faktor-Zert. 2013-o.f. Verfall auf Faktor 6x Short SMIF Index 29.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	22.02.2013	10.10.2017	10.00	20 714 828	-				CHF			(I)

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

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	WMV	Laufzeit / Durée / Durata		Nominell / Valeur nominale / Valore nominale	Valoren-Nr. / No de valeur / Numero di valore	Steuerwert / Val. imposable / Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
DB ETC Index PLC, St Helier, Jersey													
Exchange Traded Commodities on OY Brent Crude Oil EUR-Index	EUR	02.02.2010	02.02.2060	100.00	11 095 185	66.420				EUR			(I)
ETC on db Physical Gold Commodity Series 16 25.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	05.12.2012	05.12.2062	0.000	20 027 767	-				CHF			(I)
DB ETC PLC, St Helier, Jersey													
Exchange Traded Commodity on Physical Silver Commodity S30	USD	15.06.2010	15.06.2060	100.00	11 426 260	160.240		15.06.		USD			(I)
ETC Securities Physical Gold Commodity	USD	15.06.2010	15.06.2060	0.000	11 426 331	124.230		15.06.		USD			(I)
Physical Gold Euro Hedged ETC on Gold	EUR	15.06.2010	15.06.2060	99.68	11 425 418	109.730		15.06.		EUR	0.000	0.000	
Physical Platinum ETC on Platinum Commodity	USD	14.07.2010	14.07.2060	0.000	11 517 903	87.790				USD			(I)
Physical Palladium Euro Hedged ETC on Palladium	EUR	14.07.2010	14.07.2060	36.54	11 517 929	84.430				EUR			(I)
ETC on Commodity Palladium Series 7	USD	14.07.2010	14.07.2060	0.000	11 517 922	100.280		14.07.		USD	0.000	0.000	
ETC Securities on Silver 1 Oz	EUR	27.08.2010	27.08.2060	190.30	11 660 928	158.960				EUR			(I)
ETC Securities on Gold	EUR	27.08.2010	27.08.2060	123.50	11 660 968	123.860				EUR			(I)
Physical Rhodium ETC on Rhodium	EUR	28.02.2011	28.02.2061	0.000	12 474 038	142.240				EUR			(I)
Deutsche Bank AG, Frankfurt am Main, Deutschland													
Zertifikate X-pert Zertifikat auf Nikkei 225 Index	EUR	13.02.2001		0.000	1 176 198	19.950				EUR			(I)
Zertifikate X-pert Zertifikat auf Dow Jones Euro Stoxx 50 Index	EUR	13.02.2001		0.000	1 176 228	37.230				EUR			(I)
Zertifikate X-pert Zertifikat auf Topix Index	EUR	13.02.2001		0.000	1 176 190	15.790				EUR			(I)
Zertifikate X-pert Zertifikat auf Dow Jones Euro Stoxx Telecom Index	EUR	13.02.2001		0.000	1 176 283	36.350				EUR			(I)
Zertifikate X-pert Zertifikat auf S&P 500 Index	EUR	13.02.2001		0.000	1 176 183	26.440				EUR			(I)
X-pert Zertifikat auf Dow Jones Industrial Average 3.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	15.10.2001		0.000	1 292 295	-				EUR	0.000	0.000	
X-pert Zertifikat auf FTSE 100 Index	EUR	20.12.2001		0.000	1 344 023	101.550				EUR			(I)
X-Pert-Zert. 2003-ohne festen Verfall auf Korea Stock Price-Index 200	EUR	22.12.2003		0.000	1 746 613	297.740		22.12.		EUR	0.000	0.000	
x-pert Zertifikat auf den Swiss Market Index [SMI]	CHF	22.12.2003		0.000	1 746 806	94.050				CHF			(I)
Index-Zert. 2014-o.f. Verfall auf Boerse.de-Champions-Defensiv-Index	EUR	03.07.2014		0.000	24 823 429	158.610		03.07.		EUR			(I)
Zertifikate X-pert Zertifikat auf Xetra Dax Total Return Index 4.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	13.02.2001	15.05.2017	0.000	1 176 169	-		04.05.		EUR	0.000	0.000	
Index-Zert. auf Nikkei 225-Index	EUR	03.12.2013	28.12.2017	0.000	23 007 443	-				EUR			(I)
Deutsche Bank AG, London Branch, London, Grossbritannien													
Zertifikate X-pert Zertifikat auf Nasdaq 100 Index	EUR	13.02.2001		0.000	1 176 200	63.180				EUR			(I)
Zertifikate X-pert Zertifikat auf Dow Jones Euro Stoxx 50 Index	EUR	13.02.2001		0.000	1 176 212	41.300		13.02.		EUR			(I)
Croci Euro plus Certificates 2004-Without Fixed Maturity	EUR	16.08.2004		100.00	1 905 396	334.330				EUR			(I)
Tracker Certificate on a Basket of Shs	CHF	12.03.2015	13.03.2017	0.000	26 684 631	-		13.03.		CHF		0.000	
Price Tracker on S&P Global Water Index	EUR	12.05.2015	05.05.2017	1'000.00	26 684 818	-		12.05.		EUR	0.000	0.000	
Certificate on DB CROCI World Giants Euro Index	EUR	27.07.2007	04.08.2017	100.00	3 250 958	-				EUR			(I)
DZ BANK AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank, Frankfurt A/ Main, Deutschland													
Index-Zert. 2002-ohne festen Verfall Serie 3 auf DJ Euro Stoxx 50-Index	EUR	08.08.2002		25.39	1 469 506	41.080				EUR			(I)

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

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	WMV	Laufzeit Durée Durata		Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
EFG International Finance (Guernsey) Limited, Guernsey													
Underlying Tracker on EUR Enhanced Dividend Index	EUR	12.01.2015	13.01.2020	1'000.00	25 445 169	99.300				EUR			(I)
ETFS Commodity Securities Ltd, St Helier, Jersey													
Individual Commodity Securites 2008-without fixed maturity on Leveraged Silver	EUR			0.000	4 246 434	6.320				EUR			(I)
Regd.Commodity Securities 2006-Without Fixed Maturity on DJ-UBS Indl Metals Sub Idx	USD	22.09.2006		20.82	2 726 111	13.100		22.09.		USD	0.000	0.000	
Regd.Commodity Securities 2006-Without Fixed Maturity on DJ UBS Natural Gas Sub Index	USD	27.09.2006		2.69	2 723 264	0.030		27.09.		USD	0.000	0.000	
Regd.Commodity Securities 2006-Without Fixed Maturity on UBS Blmbrg Grains Ix Secured	USD	27.09.2006		50.00	2 726 124	3.200		27.09.		USD	0.000	0.000	
Commodity Security 2006-Without Fixed Maturity on UBS Copper Sub Idx Secured	USD	27.09.2006		40.97	2 723 229	30.200		27.09.		USD			(I)
Individual Commodity Security 2006-Without fixed Maturity on Crude Oil Commodity Index	USD	03.11.2006		42.19	2 776 054	8.360		03.11.		USD	0.000	0.000	
Regd.Leveraged Commodity Securities 2008-Without Fixed Maturity on UBS Gold Subindex Secured	USD	11.03.2008		50.18	3 782 675	40.230				USD			(I)
ETFS Hedged Commodity Securities Limited, St. Helier, Jersey													
Regd.Swiss Franc Currency-Hedged Commodity Securities 2013-Without Eixed Mat.on Swiss Franc Hedged Gold Cmdty	CHF	29.11.2012		10.00	20 137 193	6.360				CHF			(I)
Regd.Swiss Franc Currency-Hedged Commodity Securities 2013-Without Fixed Mat.on Swiss Franc Hedged Agriculture	CHF	29.11.2012		10.00	20 135 848	5.130				CHF			(I)
Regd.Swiss Franc Currency-Hedged Commodity Securities 2013-Without Fixed Mat.on Swiss Franc Hedged Aluminium Cmdty	CHF	29.11.2012		10.00	20 136 326	7.560				CHF			(I)
Regd.Swiss Franc Currency-Hedged Commodity Securities 2013-Without Fixed Mat.on Swiss Franc Hedged Agriculture	CHF	30.11.2012		10.00	20 136 380	5.290				CHF			(I)
Regd.Swiss Franc Currency-Hedged Commodity Securities 2013-Without Fixed Mat.on Swiss Franc Hedged Forward Energy	CHF	30.11.2012		10.00	20 136 581	4.700				CHF			(I)
Regd.Swiss Franc Currency-Hedged Commodity Securities 2013-Without Fixed Mat.on Swiss Franc Hedged Copper Cmdty	CHF	30.11.2012		10.00	20 136 336	7.360				CHF			(I)
Regd.Swiss Franc Currency-Hedged Commodity Securities 2013-Without Fixed Mat.on Swiss Franc Hedged Corn Cmdty	CHF	30.11.2012		10.00	20 136 337	3.260				CHF			(I)
Regd.Swiss Franc Currency-Hedged Commodity Securities 2013-Without Fixed Mat.on Swiss Franc Hedged Cotton Cmdty	CHF	30.11.2012		10.00	20 136 369	9.270				CHF			(I)
Regd.Swiss Franc Currency-Hedged Commodity Securities 2013-Without Fixed Mat.on Swiss Franc Hedged Tin Commodity	CHF	30.11.2012		10.00	20 137 214	7.290				CHF			(I)
Regd.Swiss Franc Currency-Hedged Commodity Securities 2013-Without Fixed Mat.on Swiss Franc Hedged Softs Cmdty	CHF	30.11.2012		10.00	20 137 209	5.610				CHF			(I)
Regd.Swiss Franc Currency-Hedged Commodity Securities 2013-Without Fixed Mat.on Swiss Franc Hedged Silver Cmdty	CHF	30.11.2012		10.00	20 137 208	4.230				CHF			(I)

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

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	WMV	Laufzeit Durée Durata	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017					
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Regd.Swiss Franc Currency-Hedged Commodity Securities 2013-Without Fixed Mat.on Swiss Franc Hedged Precious Metal	CHF	30.11.2012	10.00	20 137 207	5.770				CHF		(I)
Regd.Swiss Franc Currency-Hedged Commodity Securities 2013-Without Fixed Mat.on Swiss Franc Hedged Platinum Cmdty	CHF	30.11.2012	10.00	20 137 206	4.560				CHF		(I)
Regd.Swiss Franc Currency-Hedged Commodity Securities 2013-Without Fixed Mat.on Swiss Franc Hedged Lead Cmdty	CHF	30.11.2012	10.00	20 137 198	8.770				CHF		(I)
Regd.Swiss Franc Currency-Hedged Commodity Securities 2013-Without Fixed Mat.on Swiss Franc Hedged Indl Metals	CHF	30.11.2012	10.00	20 137 197	7.970				CHF		(I)
Regd.Swiss Franc Currency-Hedged Commodity Securities 2013-Without Fixed Mat.on Swiss Franc Hedged All Cmdty	CHF	30.11.2012	10.00	20 136 381	6.020				CHF		(I)
Regd.Swiss Franc Currency-Hedged Commodity Securities 2013-Without Fixed Mat.on Swiss Franc Hedged Zinc Cmdty	CHF	22.01.2013	10.00	20 137 216	12.800				CHF		(I)
ETFS Metal Securities Ltd, St Helier, Jersey											
Exchange Trade Commodity 2006-o.f. Verfall auf Palladium	USD		38.10	3 139 290	-		01.09.		USD	0.000	0.000
Regd.Certificates 2007-Without Fixed Maturity On PM Basket	USD	24.04.2007	65.20	3 068 585	95.510		24.04.		USD		(I)
ETFS Oil Securities Ltd, St Helier, Jersey											
Exchange Traded Commodity 2006-open end on ICE 1 month Brent Crude Oil-Futures	EUR	31.12.2006	0.000	2 778 027	27.270				EUR		(I)
Exane Finance, Paris, Frankreich											
Alpha Long Short Certificate 2012-Open on a Basket of Indices	EUR	27.11.2012	1'000.00	20 087 108	82.370		27.11.		EUR		(I)
Bull Certificate 2013-without final maturity on NEMO RI Index	EUR	09.04.2013	0.000	20 975 053	1023.690				EUR		(I)
Bull Certificate 2013-without final maturity on Exane NEMO RI Index	USD	10.04.2013	1'000.00	20 975 052	790.910				USD		(I)

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

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	W M V	Laufzeit Durée Durata	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017					
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
Gold Bullion Securities Limited, St Helier, Jersey											
Gold Bullion Sec Notes 2007-without fixed maturity on Gold	EUR	24.10.2008	0.00001	3 079 689	119.630		24.10.		EUR	0.000	0.000

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

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	W M V	Laufzeit Durée Durata		Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data		Cp.	W M V	Brutto Brut lordo	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
							ex. (E)	zahlb. pay. pag.			Fr.W.		
HSBC Bank PLC, London, Grossbritannien													
Reshuffle Bull Notes on a Basket of Indices Senior	USD	23.12.2013	24.12.2018	1'000.00	22 523 956	1622.050		31.12.		USD			(I)
HSBC Trinkaus & Burkhardt AG, Düsseldorf, Deutschland													
Faktor-Partizipation-Zert. 2015-o.f. Verfall auf Faktor 2,5 Brent-Crude-Fut (long)Idx	EUR	20.03.2015		94.84	27 376 852	47.510				EUR			(I)

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

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	W M V	Laufzeit Durée Durata		Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data		Cp.	W M V	Brutto Brut lordo	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible	
							ex. (E)	zahlb. pay. pag.			Fr.W.	CHF	
iShares Physical Metals PLC, Irland													
Regd.Secured Precious Metal Linked Notes 2011-Without Fixed Maturity on Commodity Platinum Secured	USD	08.04.2011		0.000	12 881 555	13.250		08.04.		USD	0.000	0.000	
Regd.Secured Precious Metal Linked Notes 2011-Without Fixed Maturity on Commodity Silver Secured	USD	08.04.2011		0.000	12 881 547	15.430		08.04.		USD			(I)
Regd.Secured Precious Metal Linked Notes 2011-Without Fixed Maturity on Commodity Palladium Secured	USD	08.04.2011		0.000	12 881 557	30.350		08.04.		USD			(I)

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

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	W M V	Laufzeit Durée Durata		Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data		Cp.	W M V	Brutto Brut lordo	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible	
							ex. (E)	zahlb. pay. pag.			Fr.W.	CHF	
Lang & Schwarz Aktiengesellschaft, Düsseldorf, Deutschland													
Index-Zert. 2013-o.f. Verfall auf Wikifolio-Index Div. und E. Deutsch.	EUR	04.02.2013		116.38	20 601 130	385.960		04.02.		EUR			(I)
LGT Bank AG, Vaduz, Liechtenstein													
Cert. auf GATS Index	EUR	20.09.2004	30.09.2019	0.000	1 942 706	8540.090		31.12.		EUR	18.330	21.448	
LGT-Certifikate auf GIM Index II	EUR	31.03.2006	31.03.2021	0.000	2 455 843	9338.060		31.12.		EUR	11.797	13.804	
LGT-Cert. auf GIM Index III	EUR	31.07.2006	31.07.2021	0.000	2 601 370	7968.010		31.12.		EUR	10.062	11.774	
LGT-Zertifikate auf GIM Index	EUR	26.02.2002	28.02.2022	0.000	1 381 295	11206.110		31.12.		EUR	14.157	16.565	
LGT-Certifikate auf GIM Index	EUR	30.06.2004	30.06.2024	0.000	1 866 991	9338.060		31.12.		EUR	11.797	13.804	

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

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	W M V	Laufzeit Durée Durata		Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data		Cp.	W M V	Brutto Brut lordo	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible	
							ex. (E)	zahlb. pay. pag.			Fr.W.	CHF	
Merrill Lynch International & Co CV, Curacao, Curaçao													
Zertifikat auf Hang Seng China Enterprises Index	CHF	08.03.2007	08.03.2017	0.000	2 891 932	-				CHF			(I)

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

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	W M V	Laufzeit Durée Durata		Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017					
							Datum / Date Data		Cp.	W M V	Brutto Brut lordo	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible
							ex. (E)	zahlb. pay. pag.			Fr.W.	CHF
Notenstein Finance (Guernsey) Ltd, St Peter Port, Guernsey												
Underlying Tracker on Equities	CHF	21.11.2014	23.11.2017	100.00	24 972 815	-		22.05.		CHF		4.240

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

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	W M V	Laufzeit Durée Durata		Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data		Cp.	W M V	Brutto Brut lordo	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
							ex. (E)	zahlb. pay. pag.			Fr.W.		
Raiffeisen Centrobank AG, Wien, Österreich													
Zert. 2004-ohne festen Verfall auf Brent Crude Oil-Future	EUR	01.11.2004		0.000	1 988 637	2.660		01.11.		EUR			(I)
Royal Bank of Canada, London Branch, London, Grossbritannien													
Tracker Certificates on a Basket of Shs	USD	13.02.2015	17.02.2017	100.00	25 280 651	-		17.02.		USD	1.500	1.501	

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

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	W M V	Laufzeit Durée Durata		Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data		Cp.	W M V	Brutto Brut lordo	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
							ex. (E)	zahlb. pay. pag.			Fr.W.		
SG Issuer SA, Luxemburg													
Underlying Tracker on Enrgy Slct Scr NTR	CHF	21.10.2016	20.10.2017	111.82	33 119 662	-				CHF			(I)
Underlying Tracker on S&P SS Cap 20% Tech	CHF	21.10.2016	20.10.2017	117.07	33 119 665	-				CHF			(I)
SGA Societe Generale Acceptance NV, Willemstad, Curaçao													
Cert. 2005-without maturity on gold	EUR	17.08.2005		43.60	2 269 148	104.140				EUR			(I)
Source Physical Markets PLC, Dublin, Irland													
Certificates 2015-31.12.2100 on Gold Commodity Series 1 Secured	USD	25.06.2009	31.12.2100	0.000	10 326 235	123.890		31.12.		USD	0.000	0.000	

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

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	W M V	Laufzeit Durée Durata	Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017					
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF
The Royal Bank of Scotland N.V., Amsterdam, Niederlande											
Open End Cert 2004-Without fixed mat. om BNP India Total Return Index	USD	06.02.2004	4.05	1 776 057	11.830		06.02.		USD	0.000	0.000
The Royal Bank of Scotland PLC, Edinburgh, Grossbritannien											
Open End Certificate 2009-Without Fixed Maturity on Brent Crude Oil Future	USD	25.02.2009	4.09	4 870 119	4.460		25.02.		USD	0.000	0.000

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

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	W M V	Laufzeit Durée Durata		Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
UBS AG, London Branch, London, Grossbritannien													
Open End PERLES auf Dow Jones Euro Stoxx 50 Index	EUR	11.01.2001		0.000	1 176 308	40.650		11.01.		EUR	0.000	0.000	
Open End PERLES auf S&P 500 Index	USD	23.08.2001		0.000	1 274 597	448.250				USD			(I)
Open End PERLES auf Nikkei 225 Index	CHF	23.10.2001		0.000	1 312 730	19.750		23.10.		CHF		0.000	
Index-Cert. 2001-open end on DJ Euro STOXX 50 Total Ret. -Index	EUR	11.12.2001		0.000	1 338 086	77.350		11.12.		EUR	0.000	0.000	
Open End PERLES auf Dow Jones Stoxx 50 Total Return Index	EUR	30.01.2002		0.000	1 363 316	75.410		30.01.		EUR	0.000	0.000	
Open End PERLES auf Dow Jones Euro Stoxx 50 Total Return Index	EUR	30.01.2002		0.000	1 361 566	77.520		30.06.		EUR			(I)
Open End PERLES vom Dow Jones Stoxx 600 Energy Index	EUR	18.02.2002		0.000	1 371 597	36.920		18.02.		EUR	0.000	0.000	
Open End PERLES auf Dow Jones Stoxx 600 Auto Index	EUR	18.02.2002		0.000	1 371 593	71.760		18.02.		EUR	0.000	0.000	
Open End PERLES auf Dow Jones Stoxx 600 Utility Index	EUR	18.02.2002		0.000	1 371 601	34.140		18.02.		EUR	0.000	0.000	
Open End PERLES auf Dow Jones Stoxx 600 Insurance Index	EUR	18.02.2002		0.000	1 371 599	33.410		18.02.		EUR	0.000	0.000	
Open End PERLES auf S&P 500 Index	USD	12.06.2002		0.000	1 432 613	260.420				USD	0.000	0.000	
Open End PERLES auf Amex Oil Index	EUR	26.06.2002		0.000	1 438 854	129.380		26.06.		EUR	0.000	0.000	
Open End Index-Cert. 2003-without final maturity on Germany Discount-Index on DAX	EUR	21.02.2003		102.00	1 543 231	288.530		21.02.		EUR	0.000	0.000	
Open End PERLES auf Russian Traded Index	USD	27.06.2003		0.000	1 614 420	154.450		27.06.		USD	0.000	0.000	
PERLES auf Hui-Amex Gold Bugs Index	USD	04.12.2003		0.000	1 728 107	176.670		04.12.		USD	0.000	0.000	
Certificates 2004-Without Fixed Maturity	EUR	18.06.2004		0.000	1 878 480	35.520		18.06.		EUR	0.000	0.000	
Certificates 2004-Without Fixed Maturity On DJ Stoxx 600 Telecomm.Index	EUR	18.06.2004		0.000	1 878 527	32.850		18.06.		EUR	0.000	0.000	
Certificate 2005-Without final maturity	EUR	15.02.2005		30.06	2 056 723	46.390		15.02.		EUR	0.000	0.000	
Cert. 2005-open end on DJ Euro Stoxx Select Dividend 30 Index	EUR	22.04.2005		25.49	2 126 459	49.040		22.04.		EUR	0.000	0.000	
Open End PERLES 2005-Open end on S&P GSCI Energy ER Index	USD	04.05.2005		533.64	2 138 250	118.990		04.05.		USD	0.000	0.000	
Open End Perles 2005- Open End on S&P GSCI Natural Gas ER Index	USD	24.05.2005		17.05	2 155 112	0.090		24.05.		USD	0.000	0.000	
Open End PERLES 2006-perpetual on S&P 500 Total Return Index	USD	29.03.2006		19.50	2 490 605	48.810		29.03.		USD	0.000	0.000	
Open End PERLES 2006-perpetual on MSCI UK Net Total Return Index	GBP	02.06.2006		57.04	2 567 796	125.590		02.06.		GBP	0.000	0.000	
Open End Perles auf UBS Global Infrastructure Index Rotator (INFRA)	CHF	28.12.2006		0.000	2 802 773	115.500		28.12.		CHF		0.000	
PERLES 2007-Open End on DJ Asia Select Dividend 30 Total Ret. Index	USD	30.01.2007		683.26	2 867 876	1360.540		30.01.		USD	0.000	0.000	
Open End Certificates 2007-Without Fixed Maturity on DJ EuroStoxx Select 30 Index	EUR	09.05.2007		0.000	3 068 980	24.470		09.05.		EUR	0.000	0.000	
UBS ETC 2007- open end on UBS Bloomb.CMCI Brent Crude Oil ER 6Mts	USD	20.07.2007		1'339.58	3 266 170	778.280		01.01.		USD	0.170	0.17491	
UBS ETC 2007- open End on UBS Bloomberg CMCI Brent Crude Oil 1Y	USD	20.07.2007		1'306.14	3 266 171	913.430		01.01.		USD	0.210	0.21607	
UBS ETC 2007- open End on UBS Bloomberg CMCI Brent Crude Oil TR	USD	20.07.2007		1'345.50	3 266 168	756.320		01.01. 20.07.		USD USD	0.170	0.17491	(I)
UBS ETC 2007- open end on UBS Bloomb.CMCI WTI Crude Oil TR 1Y	USD	27.08.2007		1'184.63	3 333 336	857.060		01.01.		USD	0.210	0.21607	
UBS ETC 2007- open end on UBS Bloomb.CMCI WTI Crude Oil TR 3Mth	USD	27.08.2007		1'239.25	3 333 334	435.580		01.01.		USD	0.100	0.10289	
UBS ETC 2007- open end on UBS Bloomb.CMCI WTI Crude Oil TR 6Mth	USD	27.08.2007		1'220.70	3 333 335	695.090		01.01.		USD	0.170	0.17491	
UBS ETC 2007- open end on UBS Bloomberg CMCI Composite CHF Hdg TR	CHF	16.11.2007		1'249.88	3 480 816	767.000		16.11.		CHF			(I)
UBS ETC 2007-open end in UBS Bloomber Industrial Metals Total Return	USD	27.11.2007		1'172.60	3 565 741	951.740		27.11.		USD	0.000	0.000	
UBS ETC 2007- open on UBS Bloomberg CMCI Brent Crude Oil CHF Hdg TR	CHF	28.11.2007		1'644.14	3 578 785	647.820		28.11.		CHF		0.000	
UBS ETC 2007- open on UBS Bloomberg CMCI Agriculture CHF Hgd TR Ind	CHF	28.11.2007		1'149.26	3 578 780	885.500		28.11.		CHF		0.000	
UBS ETC 2007 - open on UBS Bloomberg CMCI Industrial Metals	CHF	18.12.2007		1'128.28	3 624 902	834.530		18.12.		CHF		0.000	

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

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	WMV	Laufzeit / Durée / Durata	Nominell / Valeur nominale / Valore nominale	Valoren-Nr. / No de valeur / Numero di valore	Steuerwert / Val. imposable / Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
						Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
UBS ETC 2007- open end on UBS Bloomberg CMCI Industrial Metals	EUR	18.12.2007	1'141.55	3 624 901	1054.440		18.12.		EUR	0.000	0.000	
UBS ETC 2007 - open on UBS Bloomberg CMCI Gold CHF Hedged Index	CHF	18.12.2007	1'217.84	3 624 905	1473.110		18.12.		CHF		0.000	
ETC 2008-open end on UBS Bloomb.CMCI WTI Crude Oil Hedged Ind.	EUR	25.01.2008	1'643.65	3 706 984	678.870		25.01.		EUR	0.000	0.000	
UBS ETC 2008-open end on UBS Bloomberg CMCI Corn CHF Hedged TR Index	CHF	25.01.2008	1'180.65	3 683 501	455.120		25.01.		CHF		0.000	
ETC 2008-Open End on UBS Bloomberg Wheat CHF Hedged Index	CHF	25.01.2008	2'011.37	3 683 502	195.780		25.01.		CHF		0.000	
UBS ETC 2008-Open end on UBS Bloomberg CMCI Gold Index	USD	25.01.2008	1'332.78	3 699 142	1703.640		01.01.		USD	1.100	1.131	
ETC 2008- open end on UBS Bloomberg CMCI WTI Crude Oil	CHF	15.02.2008	0.000	3 706 987	549.000		15.02.		CHF		0.000	
ETC 2008-open end on UBS Bloomberg CMCI Natural Gas Index	USD	15.02.2008	996.37	3 778 765	57.240		15.02.		USD	0.000	0.000	
ETC 2008- open end on UBS Bloomberg CMCI Copper Index	USD	15.02.2008	1'532.50	3 778 758	1484.670		15.02.		USD	0.000	0.000	
ETC 2008- open end on UBS Bloomberg CMCI Platinum Index 23.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	07.04.2008	1'793.34	3 919 421	-		07.04.		USD	0.000	0.000	
ETC 2008- open end on UBS Bloomberg CMCI Copper CHF Hedged	CHF	07.04.2008	1'694.10	3 778 790	1313.000		07.04.		CHF		0.000	
ETC 2008- open end on UBS Bloomberg CMCI Platinum CHF Hdg Index 23.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	07.04.2008	1'748.32	3 920 560	-		07.04.		CHF		0.000	
UBS ETC 2008-open end on UBS Bloomberg CMCI Nickel CHF Hedged Index	CHF	28.04.2008	889.13	3 778 798	275.460		28.04.		CHF		0.000	
ETC 2008- Open end on UBS Bloomb.CMCI Natural Gas CHF Hedged Ind	CHF	16.06.2008	1'391.65	4 299 009	33.620		16.06.		CHF		0.000	
UBS ETC 2008-open end on CMCI Natral Gas EUR Hedeged Index	EUR	16.06.2008	1'422.60	4 299 008	63.240		16.06.		EUR	0.000	0.000	
Open End PERLES 2008-open end on MSCI Net TR Europe Euro	EUR	24.06.2008	134.45	4 286 374	141.510		24.06.		EUR	0.000	0.000	
ETC 2x Long 2009- Open End on CMCI WTI Crude Oil USD ER Index	USD	24.02.2009	803.21	3 573 036	185.150		01.01.		USD	0.000	0.000	
ETC 2x Short 2009- Open End on CMCI WTI Crude Oil USD ER Index 3Mt	USD	24.02.2009	803.21	3 573 037	85.120		01.01.		USD	0.000	0.000	
PERLES 2009- Open End on FTSE Xinhua China A 50 Index	USD	07.08.2009	191.64	10 293 816	192.650		07.08.		USD	0.000	0.000	
UBS ETC 2x Long 2009- Open End on UBS Bloomberg CMCI Silver Index	USD	23.11.2009	1'190.58	10 270 905	360.790		01.01.		USD	0.000	0.000	
UBS ETC 2x Long 2009- Open End on UBS Bloomberg CMCI Gold Index	USD	23.11.2009	1'552.76	10 270 904	1268.760		01.01.		USD	0.000	0.000	
UBS ETC 2x Short 2009- Open End on UBS Bloomberg CMCI Silver Index	USD	23.11.2009	1'196.09	10 272 596	166.440		01.01.		USD			(I)
UBS-ETT 2010- Open End on DAX	EUR	22.01.2010	599.58	10 834 742	1515.340		22.01.		EUR	0.000	0.000	
UBS-ETT 2010- Open End on DJ Stoxx Small 200 Net TR Index	EUR	22.01.2010	245.66	10 834 757	646.500		22.01.		EUR	0.000	0.000	
UBS ETC 2010-open End on Commodity Index	USD	22.02.2010	1'232.03	11 025 745	1065.100				USD	0.000	0.000	
UBS ETC 2010- Open End on UBS Bloomberg CMCI Composite AUD TR	AUD	03.08.2010	1'104.97	11 576 502	769.610		01.01.		AUD	7.106	5.279	
ETT 2010-Open End on S&P 500 Information Technology TR Index	USD	26.11.2010	432.34	11 939 755	1300.920		26.11.		USD	0.000	0.000	
ETT 2010-Open End on MSCI China Net Total Return Index	USD	26.11.2010	388.32	11 939 748	588.580		26.11.		USD	0.000	0.000	
ETT 2010-Open End on Russian Depositary Total Return Index	USD	26.11.2010	1'873.54	11 939 751	1885.600		26.11.		USD	0.000	0.000	
PERLES 2011-Open End on MSCI Daily TR Net USA Index	USD	17.03.2011	307.93	12 224 347	686.030		17.03.		USD	0.000	0.000	
PERLES 2011-Open End on DJ-UBS CMCI Composite USD	USD	30.03.2011	140.25	12 737 948	81.270		30.03.		USD	0.000	0.000	
PERLES 2011-Open End on S&P 500 Div. Aristocrat TR Index	USD	03.05.2011	257.79	12 899 904	603.200		03.05.		USD	0.000	0.000	
PERLES 2011-Open End to S&P 500 Div.Arist.TR Index in CHF	CHF	03.08.2011	100.00	13 448 893	229.600		03.08.		CHF		0.000	
PERLES 2011-Open End to S&P 500 Div.Arist.TR Index in EUR	EUR	03.08.2011	100.00	13 449 158	273.600		03.08.		EUR	0.000	0.000	

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

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	W M V	Laufzeit Durée Durata		Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	W M V	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Open End PERLES 2012-without fixed maturity on DJ CH Slc Dvd15 TRG	EUR	23.02.2012		27.23	14 730 403	58.210		23.02.		EUR	0.000	0.000	
Certificates 2012-Without fixed maturity on S&P 400 Midcap Index	USD	03.05.2012		130.74	18 475 560	275.040				USD	0.000	0.000	
Open End PERLES 2013-Without Fixed Maturity on UBS Multi Asset Portfolio Idx	EUR	11.02.2013		263.86	19 747 701	259.070		01.01.		EUR			(I)
Open End PERLES 2013-Without Fixed Maturity on ULTARASP Index	USD	01.03.2013		66.80	20 678 598	72.450		01.01.		USD	0.400	0.41157	
Perles Certificates 2013-Without fixed maturity on Solactive 3D Printing Index	EUR	03.04.2013		100.00	21 025 522	146.850		03.04.		EUR	0.000	0.000	
ETC 2013-without fixed maturity on XMCCTR	CHF	26.04.2013		114.08	21 179 426	81.770		26.04.		CHF			(I)
ETC 2013-without fixed maturity on CMCITR	USD	26.04.2013		121.51	21 179 425	88.440		26.04.		USD	0.000	0.000	
Open End PERLES Certificates 2013-Without fixed maturity on UBS GEM RADA Strategy Index	USD	29.04.2013		102.37	20 678 597	83.220		01.01.		USD	0.000	0.000	
Tracker Certificate 2013-Open End on MSCI Daily TR Gross USA Index	USD	24.05.2013		61.52	21 179 914	105.040		24.05.		USD	0.000	0.000	
UBS-ETT Certificates 2013-Without Fixed Maturity on IBEX 35 Net Return Index	EUR	09.10.2013		187.87	22 522 711	269.480		09.10.		EUR	0.000	0.000	
Underlying Tracker 2013-Without Final Maturity on Cushing 30 MLP Total Ret Idx	USD	18.10.2013		92.21	22 578 758	80.330		18.10.		USD	0.000	0.000	
PERLES 2013-open end on MSCI USA Hdge to CHF Gross TR Index	CHF	11.12.2013		16.43	22 698 124	24.600				CHF			(I)
Tracker Certificate 2013-open end on MSCI World Net Total Return Index	USD	12.12.2013		450.14	23 090 050	574.940		12.12.		USD	0.000	0.000	
Open End Index-Cert. 2014-Open End on Solactive Guru-Index	EUR	25.08.2014		100.00	25 078 060	143.100		25.08.		EUR	0.000	0.000	
Underlying Tracker 2015-without fixed maturity on Solactive Val InvT R Idx(USD)	USD	25.03.2015		162.05	27 211 035	190.020		25.03.		USD	0.000	0.000	
Underlying Tracker 2015-open end on MSCI Daily Gross TR EMU Euro Index	EUR	22.06.2015		194.81	28 598 023	260.000		22.06.		EUR	0.000	0.000	
Underlying Tracker 2015-without fixed maturity on Solactive Fin TotReturn CHF	CHF	01.07.2015		100.00	27 774 734	144.200		01.07.		CHF		0.000	
Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on DAX	USD	02.12.2016		127.79	32 836 897	112.080		01.01.		USD	0.010	0.01028	
Underlying Tracker on Basket	EUR	24.10.2016	24.10.2017	1'000.00	34 012 542	-		24.10.		EUR	7.500	8.730	
Underlying Tracker on Basket	CHF	24.10.2016	24.10.2017	1'000.00	34 012 543	-		24.10.		CHF		0.500	
Underlying Tracker on Equities	NOK	26.02.2016	19.02.2018	947.00	31 370 655	164.050		26.02.		NOK	0.000	0.000	
Underlying Tracker on Equities	CHF	28.04.2016	30.04.2018	100.00	31 935 906	131.000		30.04.		CHF		0.000	
PERLES 2006-Open End on UBS Metals & Mining Index	CHF	27.04.2006	04.05.2018	101.00	2 490 608	78.500		27.04.		CHF		0.000	
Tracker Certificates on Basket	EUR	05.07.2013	05.07.2018	100.00	21 673 575	150.830		01.01.		EUR			(I)
Underlying Tracker on Equities	USD	18.11.2016	19.11.2018	97.95	34 427 093	122.190		19.11.		USD	0.000	0.000	
Underlying Tracker on Equities	EUR	29.03.2016	28.03.2019	94.75	31 541 432	152.580		28.03.		EUR	0.000	0.000	
Underlying Tracker on Equities	EUR	19.05.2016	20.05.2019	96.54	31 994 272	133.390		20.05.		EUR	0.000	0.000	
Underlying Tracker on Equities	USD	31.05.2016	31.05.2019	1'000.00	32 537 893	1099.900				USD			(I)
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	02.09.2015	23.08.2019	263.80	29 185 063	277.750		23.08.		CHF		0.000	
Underlying Tracker on Equities	EUR	24.08.2015	26.08.2019	100.00	28 942 309	103.380		24.08.		EUR	0.000	0.000	
Underlying Tracker on Equities	CHF	28.10.2016	25.10.2019	1'004.00	34 012 597	1226.560		28.10.		CHF		0.000	
Underlying Tracker on Basket	USD	30.05.2017	15.05.2020	100.00	36 524 585	115.570				USD	0.000	0.000	
Perles on Alerian MLP Index	USD	23.12.2010	23.12.2020	1'798.66	12 149 595	2068.810		23.12.		USD	0.000	0.000	
2XMonthly Leveraged Long Exchange T A SLkd Market Vectors Glbl Mtg REIT Idx Ser A	USD	19.10.2012	16.10.2042	25.00	19 837 845	17.190		24.01.		USD	0.7375	0.73677	
								21.02.		USD	0.0325	0.03281	
								21.03.		USD	0.0325	0.03228	
								21.04.		USD	0.693	0.69212	
								22.05.		USD	0.0925	0.08997	
								20.06.		USD	0.033	0.0322	
								24.07.		USD	0.7097	0.67139	
								21.08.		USD	0.0962	0.09238	
								21.09.		USD	0.0496	0.04826	
								23.10.		USD	0.718	0.70785	
								20.11.		USD	0.0988	0.09791	
								21.12.		USD	0.0387	0.03827	
UniCredit Bank AG, München, Deutschland													
HVB Tracker-Zert. 2012 31.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	10.02.2012	11.02.2017	21.95	14 954 666	-		05.01.		EUR	0.910	0.97438	

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

Index- und Basketzertifikate / Certificats sur un indice ou un panier d'actions / Certificati d'indice e di basket

Titel / Titres / Titoli	WMV	Laufzeit Durée Durata		Nominell Valeur nominale Valore nominale	Valoren-Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponible **31.12.2017** CHF	Ertrag / Rendement / Reddito 2017						
							Datum / Date Data ex. (E)	zahlb. pay. pag.	Cp.	WMV	Brutto Brut lordo Fr.W.	zu versteuernder Etrag/Rendement imposable/Reddito imponible CHF	
Vontobel Financial Products Ltd, Vereinigte Arabische Emirate													
Voncert 2009- Open End on Vontobel Oil-Strategy Index	CHF	15.05.2009		101.50	10 140 821	111.100				CHF			(I)
Voncert 2009- Open End on Vontobel Oil-Strategy Index	USD	15.05.2009		101.50	10 140 823	123.750				USD			(I)
VONCERT OPEN END 2009-Open End on S-BOX Smart Grid Performance Index	CHF	18.12.2009		101.50	10 778 283	133.500				CHF			(I)
Voncert Open End 2013-without fixed maturity on Equities	CHF	01.03.2013		101.50	14 150 463	140.200				CHF			(I)
VONCERT 2013-open end on Vontobel China Policy Performance-Index	CHF	07.06.2013		101.50	14 150 661	153.800				CHF			(I)
Voncert Open End 2014-without fixed maturity on Equities	EUR	31.01.2014		101.50	14 151 052	175.170				EUR			(I)
Voncert Open End 2014-without fixed maturity on Equities	CHF	31.01.2014		101.50	14 151 051	143.300		31.01.		CHF			(I)
Voncert Open End 2014-without fixed maturity on Equities	USD	31.01.2014		101.50	14 151 053	128.140		24.01.		USD			(I)
Underlying Tracker 2014-open end on Shares-Basket	CHF	06.10.2014		101.50	24 172 866	144.900				CHF			(I)
Underlying Tracker 2014-open end on Equities	EUR	12.12.2014		101.50	24 173 008	135.970				EUR			(I)
Underlying Tracker 2015-without fixed maturity on Solactive Smart Cars P Index	CHF	02.10.2015		101.50	24 173 656	198.600				CHF			(I)
Underlying Tracker 2015-Open End on SSAM	USD	19.10.2015		10'000.00	29 257 651	10743.580				USD			(I)
Underlying Tracker 2015-open end on Cyber Security Performance- Index	CHF	20.11.2015		101.50	29 258 471	133.700				CHF			(I)
Underlying Tracker 2015-open end on Cyber Security Performance- Index	USD	20.11.2015		101.50	29 258 489	132.040				USD			(I)
Underlying Tracker 2015-without fixed maturity on Yoshimichi Strat Port	USD	28.12.2015		10'000.00	30 188 742	10948.810				USD			(I)
Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on Equities	CHF	08.02.2016		101.50	30 188 932	154.900				CHF			(I)
Underlying Tracker 2016-open end on Industry 4.0 Performance-Index 6.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	08.04.2016		101.50	31 612 760	-				CHF			(I)
Underlying Tracker 2016-open end auf Basket	USD	04.05.2016		100.00	32 149 796	104.070		30.12.		USD			(I)
Underlying Tracker 2016-open end auf Basket	USD	04.05.2016		100.00	32 149 795	101.340		30.12.		USD			(I)
Underlying Tracker 2016-open end auf Basket	EUR	04.05.2016		100.00	32 149 797	126.840		30.12.		EUR			(I)
Underlying Tracker 2016-open end on Digital Marketplaces Performance-Index	USD	05.08.2016		101.50	32 760 566	135.150				USD			(I)
Underlying Tracker 2015-open end on Digital Marketplaces Perform-Index	CHF	05.08.2016		101.50	32 760 563	141.600				CHF			(I)
Underlying Tracker 2016-without fixed maturity on SOLDOPP	CHF	16.12.2016		101.50	34 182 500	136.500				CHF			(I)
Underlying Tracker on EUR/USD	USD	11.02.2016	13.02.2017	100.00	30 939 327	-				USD			(I)
Underlying Tracker on Equities	CHF	07.04.2015	03.04.2017	100.00	24 173 275	-				CHF			(I)
Voncert on Equities	USD	06.05.2014	08.05.2017	101.70	14 151 231	-				USD			(I)
Voncert on Equities	USD	06.05.2014	08.05.2017	101.00	14 151 219	-				USD			(I)
Voncert on Equities	CHF	06.05.2014	08.05.2017	101.70	14 151 229	-		08.05.		CHF			(I)
Underlying Tracker on Equities	USD	16.05.2016	16.05.2017	100.40	32 149 349	-		16.05.		USD	0.000	0.000	
Underlying Tracker on Equities	CHF	22.05.2015	22.05.2017	96.80	24 173 385	-				CHF			(I)
Underlying Tracker on "CHF Small and Midc aps" Basket	CHF	10.12.2014	09.06.2017	94.50	24 173 037	-				CHF			(I)
Voncert on Equities	EUR	17.06.2014	16.06.2017	97.60	24 172 712	-				EUR			(I)
Underlying Tracker on Equities	CHF	31.07.2015	31.07.2017	99.30	24 173 550	-		31.07.		CHF		0.700	
Underlying Tracker on Equities	CHF	17.10.2014	17.10.2017	980.00	24 172 865	-		17.10.		CHF		20.000	
Underlying Tracker on Equities	USD	18.11.2015	17.11.2017	101.50	30 187 140	-				USD			(I)
Underlying Tracker 2016-open end on The Solactive US High Dividend L V 28.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	29.04.2016	09.12.2017	101.50	31 614 450	-				USD			(I)
Underlying Tracker on Equities	CHF	19.12.2014	19.12.2017	95.10	24 173 063	-				CHF			(I)
Underlying Tracker on Equities	EUR	06.03.2015	06.03.2018	95.40	24 173 182	119.580		06.03.		EUR			(I)
Underlying Tracker on Equities	CHF	24.06.2016	22.06.2018	97.50	32 151 230	149.600				CHF		0.000	
Underlying Tracker on Equities	USD	02.11.2016	02.11.2018	100.80	34 181 231	79.800		02.11.		USD	0.000	0.000	
Underlying Tracker on Equities	USD	25.11.2016	23.11.2018	101.50	34 182 402	143.630				USD			(I)
Underlying Tracker on Equities	USD	17.06.2016	21.12.2018	96.75	32 151 603	109.530				USD	0.000	0.000	
Underlying Tracker on Equities	CHF	08.02.2016	07.02.2019	98.80	30 187 867	190.600		07.02.		CHF		0.000	
Structured Note on Gold with ref. bond	CHF	12.08.2016	12.08.2021	1'000.00	32 761 583	1014.000		12.08.		CHF		0.000	

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Abbey National plc, London, Grossbritannien												
Equity Linked Automatic Early Redemption Notes VRN on Banco Bilbao Shs S996 Sr	EUR	1'000.00	07.07.2014	08.07.2019	24 816 572	%	85.600	96.800	100.000		0.000	Y
Argentum Capital S.A., Luxemburg												
Regd.Structured Products Pro-Notes VRN Cr Lnk on Bskt of Shs & Ref Ent	USD	10'000.00	23.07.2014	24.07.2017	24 867 298		-	93.410	100.000		0.000	Y
Structured Products Pro-Notes VRN on a Bskt of Shs & Ref Ent S 45	USD	10'000.00	23.07.2014	24.07.2017	24 868 571		-	93.410	100.000		0.000	Y
Regd.Structured Products Pro-Notes VRN Cr Lnk on Bskt of Shs & Ref Ent	USD	10'000.00	23.07.2014	24.07.2017	24 868 420		-	93.410	100.000		0.000	Y
Regd.Structured Products Pro-Notes VRN Cr Lnk on Bskt of Shs & Ref Ent	USD	10'000.00	23.07.2014	24.07.2017	24 863 793		-	93.410	100.000		0.000	Y
Regd.Structured Products Pro-Notes VRN Cr Lnk on Bskt of Shs & Ref Ent	USD	10'000.00	23.07.2014	24.07.2017	24 868 075		-	93.410	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Banca IMI S.p.A., Milano, Italien												
(no min./no max.) Tasso variabile	EUR	1'000.00	18.01.2013	18.01.2017	20 521 854		-	100.000	100.000	18.01.	32.131	N
Max Long Cap Certificates on Stoxx 600 Health Care	EUR	1'000.00	30.09.2015	30.09.2020	30 051 981	CHF	1139.880	98.281	100.000		0.000	Y
Bank Bär (Julius) & Co. Ltd., Guernsey												
7.8 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	01.10.2015	03.01.2017	28 980 471		-	100.000	100.000	03.01.	0.13652	N
8.17 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	01.07.2016	03.01.2017	32 848 373		-	100.000	100.000	03.01.	0.000	Y
8.07 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	01.07.2016	03.01.2017	32 848 353		-	100.000	100.000	03.01.	0.000	Y
10.9 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.07.2016	03.01.2017	32 848 355		-	100.000	100.000	03.01.	5.030	Y
18.42 % Reverse Convertible on UniCredit	USD	1'000.00	01.07.2016	03.01.2017	32 848 357		-	100.000	100.000	03.01.	5.030	Y
9.2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	01.07.2016	03.01.2017	32 848 378		-	100.000	100.000	03.01.	0.000	Y
8.56 % Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	01.07.2016	03.01.2017	32 848 377		-	100.000	100.000	03.01.	4.870	Y
9.42 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	01.07.2016	03.01.2017	32 848 370		-	100.000	100.000	03.01.	0.000	Y
4.9 % Reverse Convertible 2015-05.01.17 on Beiersdorf	EUR	1'000.00	05.01.2016	05.01.2017	29 969 212		-	100.000	100.000	05.01.	0.37476	N
10.99 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.05.2016	06.01.2017	32 391 631		-	100.000	100.000	06.01.	7.070	Y
16.86 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.05.2016	09.01.2017	32 391 764		-	100.000	100.000	09.01.	7.010	Y
15.33 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	22.06.2016	09.01.2017	32 656 625		-	100.000	100.000	09.01.	0.000	Y
22.29 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	01.07.2016	09.01.2017	32 848 363		-	100.000	100.000	09.01.	0.000	Y
5.89 % Reverse Convertible on Bayer N	EUR	1'000.00	07.07.2016	09.01.2017	32 987 588		-	100.000	100.000	09.01.	0.000	Y
13.33 % Reverse Convertible on Intesa Sanpaolo	EUR	1'000.00	07.07.2016	09.01.2017	32 987 592		-	100.000	100.000	09.01.	0.000	Y
4.05 % Reverse Convertible on Siemens N	EUR	1'000.00	07.07.2016	09.01.2017	32 987 590		-	100.000	100.000	09.01.	0.000	Y
9.28 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.07.2016	09.01.2017	31 852 136		-	100.000	100.000	09.01.	4.810	Y
4.93 % Reverse Convertible on BASF N	EUR	1'000.00	07.07.2016	09.01.2017	32 987 589		-	100.000	100.000	09.01.	0.000	Y
5.39 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.07.2015	23.01.2017	28 545 852		-	100.000	100.000	23.01.	0.000	N
23.76 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.07.2016	23.01.2017	32 987 722		-	100.000	100.000	23.01.	5.140	Y
6.8 % Reverse Convertible on Geberit N	CHF	1'000.00	29.12.2016	26.01.2017	33 271 137		-	100.000	100.000	26.01.	0.000	Y
6.2 % Reverse Convertible on SMI	CHF	1'000.00	27.01.2016	27.01.2017	29 969 275		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	N
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	30.01.2015	30.01.2017	24 202 201		-	99.980	100.000		0.000	Y
6.76 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.07.2016	30.01.2017	32 987 777		-	100.000	100.000	30.01.	5.330	Y
5.97 % Reverse Convertible on Volkswagen Vz	EUR	1'000.00	29.07.2016	30.01.2017	33 367 453		-	100.000	100.000	30.01.	0.000	Y
5.97 % Reverse Convertible on Societe Generale	EUR	1'000.00	29.07.2016	30.01.2017	33 367 454		-	100.000	100.000	30.01.	0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	01.02.2016	01.02.2017	29 969 223		-	100.000	100.000	01.02.	0.000	N
6.05 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	01.02.2016	01.02.2017	29 969 225		-	100.000	100.000	01.02.	0.000	N
7 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	01.02.2016	01.02.2017	29 969 234		-	100.000	100.000	01.02.	0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	01.02.2016	01.02.2017	29 969 238		-	100.000	100.000	01.02.	0.000	N
5.91 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.02.2016	02.02.2017	31 126 859		-	100.000	100.000	02.02.	0.000	N
8.9 % Reverse Convertible on Galenica N	CHF	5'000.00	02.02.2016	02.02.2017	29 969 271		-	100.000	100.000	02.02.	0.000	N
6 % Reverse Convertible on Schneider Electric	EUR	1'000.00	03.08.2015	03.02.2017	27 981 927		-	100.000	100.000	03.02.	0.24062	N
9.14 % Reverse Convertible on Telefonica	USD	1'000.00	04.08.2016	06.02.2017	33 367 479		-	100.000	100.000	06.02.	5.710	Y
5.46 % Reverse Convertible on HeidelbergCement	EUR	1'000.00	04.08.2016	06.02.2017	33 367 474		-	100.000	100.000	06.02.	0.000	Y
6.15 % Reverse Convertible on Adecco N	CHF	1'000.00	09.02.2016	09.02.2017	29 969 283		-	100.000	100.000	09.02.	0.000	N
5.7 % Reverse Convertible on Givaudan N	CHF	5'000.00	09.02.2016	09.02.2017	29 969 286		-	100.000	100.000	09.02.	0.000	N
4.8 % Reverse Convertible on Swisscom N	CHF	1'000.00	09.02.2016	09.02.2017	29 969 285		-	100.000	100.000	09.02.	0.000	N
Underlying Tracker on Swisscom N	CHF	566.00	10.08.2015	10.02.2017	20 277 088		-	100.000	100.000		0.000	Y
4 3/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.08.2015	13.02.2017	27 981 898		-	100.000	100.000	13.02.	0.000	N
6 % Reverse Convertible on Novartis N	CHF	1'000.00	16.02.2016	16.02.2017	29 969 297		-	100.000	100.000	16.02.	0.000	N
3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.02.2015	20.02.2017	25 998 456		-	100.000	100.000	20.02.	0.000	N
2.45 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.02.2015	21.02.2017	26 388 768		-	100.000	100.000	21.02.	1.379	N
9.4 % Reverse Convertible on CS Group N	USD	1'000.00	19.08.2016	21.02.2017	33 541 326		-	100.000	100.000	21.02.	6.380	Y
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	96.30	27.02.2015	23.02.2017	20 277 083		-	99.980	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	257.80	27.02.2015	23.02.2017	20 277 084		-	99.980	100.000		0.000	Y
3.8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.02.2016	23.02.2017	30 856 864		-	100.000	100.000	23.02.	0.000	N
6.2 % Reverse Convertible on Daimler N	EUR	1'000.00	02.12.2016	02.03.2017	34 557 029		-	100.000	100.000	02.03.	0.000	N
9.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.03.2016	03.03.2017	30 856 839		-	100.000	100.000	03.03.	0.000	N
2 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.03.2016	03.03.2017	30 856 847		-	100.000	100.000	03.03.	0.000	N
8.2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.03.2016	03.03.2017	31 437 767		-	100.000	100.000	03.03.	0.000	N
6 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.03.2015	06.03.2017	26 388 779		-	100.000	100.000	06.03.	0.000	N
Underlying Tracker on Siemens N	EUR	85.71	07.03.2016	08.03.2017	20 277 100		-	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4.9 % Reverse Convertible on EMS-CHEM HLDG N	CHF	1'000.00	08.03.2016	08.03.2017	30 856 794		-	100.000	100.000	08.03.	0.000	N
7.66 % Reverse Convertible on Galenica N	CHF	5'000.00	11.03.2016	13.03.2017	31 809 736		-	100.000	100.000	13.03.	0.000	N
3.95 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.03.2015	17.03.2017	25 998 478		-	100.000	100.000	17.03.	0.000	N
9.4 % Reverse Convertible on CS Group N	CHF	1'000.00	22.03.2016	22.03.2017	30 856 814		-	100.000	100.000	22.03.	0.000	N
4.65 % Reverse Convertible on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	22.03.2016	22.03.2017	30 856 815		-	100.000	100.000	22.03.	0.000	N
6.3 % Reverse Convertible on L'Oreal	EUR	1'000.00	08.08.2016	23.03.2017	33 367 492		-	100.000	100.000	23.03.	0.000	Y
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	100.80	24.08.2015	24.03.2017	20 277 092		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	72.25	02.03.2016	28.03.2017	20 277 101		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	69.85	29.03.2016	29.03.2017	20 277 106		-	100.000	100.000		0.000	N
14 1/4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.03.2016	30.03.2017	30 856 876		-	100.000	100.000	30.03.	6.126	N
8.24 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.12.2016	30.03.2017	33 271 160		-	100.000	100.000	30.03.	0.000	Y
Underlying Tracker auf Roche Hldg G	CHF	263.90	02.04.2015	03.04.2017	26 388 802		-	100.000	100.000		0.000	Y
3.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.04.2015	03.04.2017	25 998 552		-	100.000	100.000	03.04.	0.000	N
4.9 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.04.2015	03.04.2017	25 998 559		-	100.000	100.000	03.04.	0.000	N
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	276.40	14.08.2015	07.04.2017	20 277 090		-	100.000	100.000		0.000	Y
8 1/4 % Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	07.04.2016	07.04.2017	30 856 888		-	100.000	100.000	07.04.	30.705	N
8.65 % Reverse Convertible on BMW	EUR	1'000.00	26.07.2016	07.04.2017	32 987 753		-	100.000	100.000	07.04.	0.000	Y
9.87 % Reverse Convertible on Netflix	USD	1'000.00	26.07.2016	07.04.2017	32 987 759		-	100.000	100.000	07.04.	8.500	Y
11.08 % Reverse Convertible on E.ON N	EUR	1'000.00	09.09.2016	07.04.2017	33 765 206		-	100.000	100.000	07.04.	0.000	Y
7.84 % Reverse Convertible on Bayer N	EUR	1'000.00	09.09.2016	07.04.2017	33 765 207		-	100.000	100.000	07.04.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.04.2016	10.04.2017	30 856 890		-	100.000	100.000	10.04.	12.360	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.04.2016	10.04.2017	30 856 889		-	100.000	100.000	10.04.	12.360	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	294.60	12.12.2014	12.04.2017	24 202 181		-	99.976	100.000		0.000	Y
8.21 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	17.10.2016	18.04.2017	34 162 274		-	100.000	100.000	18.04.	3.640	Y
7.98 % Reverse Convertible on Daimler N	EUR	1'000.00	17.10.2016	18.04.2017	34 162 279		-	100.000	100.000	18.04.	0.000	Y
12 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.04.2016	25.04.2017	30 856 959		-	100.000	100.000	25.04.	0.000	N
6 1/2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.04.2016	25.04.2017	30 856 963		-	100.000	100.000	25.04.	0.000	N
Principal Protected Note on DB Platinum	USD	100'000.00	22.02.2012	28.04.2017	14 820 743		-	75.140	80.000		0.000	Y
Floored-Cert. on Platinum IV DBX Systematic	USD	100'000.00	09.03.2012	28.04.2017	14 820 742		-	80.093	85.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	28.04.2016	28.04.2017	30 856 965		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	N
8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.04.2016	28.04.2017	30 856 966		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	N
Bonus-Zertifikat on Roche Hldg G	CHF	255.20	02.05.2014	02.05.2017	22 757 079		-	99.640	100.000		0.000	Y
JB Bonus-Zertifikat on Novartis N	CHF	75.60	02.05.2014	02.05.2017	22 757 084		-	99.640	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.04.2015	02.05.2017	26 388 816		-	100.000	100.000	30.01. 02.05.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	74.25	29.02.2016	02.05.2017	20 277 099		-	100.000	100.000		0.000	Y
9.51 % Reverse Convertible on Daimler N	EUR	1'000.00	01.11.2016	02.05.2017	34 342 622		-	100.000	100.000	02.05.	0.000	Y
8 1/4 % Reverse Convertible on L'Oreal	EUR	1'000.00	01.11.2016	02.05.2017	34 342 621		-	100.000	100.000	02.05.	0.000	Y
7.52 % Reverse Convertible on Danone	EUR	1'000.00	01.11.2016	02.05.2017	34 342 616		-	100.000	100.000	02.05.	0.000	Y
6.4 % Reverse Convertible on Galenica N	CHF	1'000.00	06.05.2016	03.05.2017	30 856 946		-	100.000	100.000	03.05.	0.000	N
Bonus-Zertifikat on Roche Hldg G	CHF	232.00	07.05.2013	08.05.2017	20 966 537		-	99.124	100.000		0.000	Y
11.08 % Reverse Convertible on Barrick Gold	USD	1'000.00	13.09.2016	08.05.2017	33 765 223		-	100.000	100.000	08.05.	9.320	Y
13.42 % Reverse Convertible on Barrick Gold	USD	1'000.00	13.09.2016	08.05.2017	33 765 225		-	100.000	100.000	08.05.	9.320	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur GrpN	CHF	213.40	16.02.2016	09.05.2017	20 277 097		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Geberit N	CHF	325.30	11.11.2015	11.05.2017	20 277 096		-	100.000	100.000		0.000	Y
8.15 % Reverse Convertible on Galenica N	CHF	5'000.00	17.05.2016	17.05.2017	31 852 033		-	100.000	100.000	17.05.	0.000	N
4 3/4 % Reverse Convertible on Nestle N	CHF	1'000.00	17.05.2016	17.05.2017	31 852 037		-	100.000	100.000	17.05.	0.000	N
10 1/4 % Reverse Convertible on Leonteq N	CHF	1'000.00	17.05.2016	17.05.2017	31 852 035		-	100.000	100.000	17.05.	0.000	N
2.7 % Multi Barrier Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	21.05.2014	19.05.2017	24 202 011		-	100.000	100.000	19.05.	2.618	N
8.44 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.05.2016	19.05.2017	32 391 664		-	100.000	100.000	19.05.	0.000	N
12.40 % Reverse Convertible on UniCredit	EUR	1'000.00	22.11.2016	23.05.2017	34 556 966		-	100.000	100.000	23.05.	0.000	Y
5.7 % Reverse Convertible on Swiss Life Hldg N	CHF	1'000.00	24.05.2016	24.05.2017	31 852 040		-	100.000	100.000	24.05.	0.000	N
Underlying Tracker auf Nestle N	CHF	73.45	27.08.2015	26.05.2017	20 277 093		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	71.15	26.02.2016	26.05.2017	20 277 098		-	100.000	100.000		0.000	Y
6.50 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.11.2016	26.05.2017	34 556 985		-	100.000	100.000	26.05.	0.000	Y
14.58 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.11.2016	30.05.2017	34 556 982		-	100.000	100.000	30.05.	6.550	Y
5.65 % Reverse Convertible on Tecan Grp N	CHF	1'000.00	31.05.2016	31.05.2017	31 852 047		-	100.000	100.000	31.05.	0.000	N
5 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.06.2016	02.06.2017	31 852 029		-	100.000	100.000	02.06.	0.000	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	02.06.2016	02.06.2017	32 519 292		-	89.232	90.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	CHF	1'000.00	02.06.2016	02.06.2017	32 519 283		-	90.000	90.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	06.06.2016	06.06.2017	32 519 300		-	89.199	90.000		0.000	Y
6 1/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	07.06.2016	07.06.2017	32 260 808		-	100.000	100.000	07.06.	0.000	N
8.29 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.06.2016	07.06.2017	32 656 511		-	100.000	100.000	07.06.	0.000	N
6.17 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.06.2016	08.06.2017	32 656 527		-	100.000	100.000	08.06.	0.000	N
6 1/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.12.2015	09.06.2017	28 980 581		-	100.000	100.000	09.06.	0.000	N
4.8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.12.2015	09.06.2017	28 980 582		-	100.000	100.000	09.06.	0.000	N
5.4 % Reverse Convertible on Coca-Cola Co	USD	1'000.00	09.06.2016	09.06.2017	27 981 866		-	100.000	100.000	09.06.	6.549	N
10.3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.12.2016	09.06.2017	33 270 918		-	100.000	100.000	09.06.	0.000	Y
Underlying Tracker on SGS N	CHF	1'730.00	10.09.2015	13.06.2017	20 277 095		-	100.000	100.000		0.000	Y
21.52 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.12.2016	15.06.2017	33 270 982		-	100.000	100.000	15.06.	6.480	Y
7.9 % Autocallable Multi Barrier Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.06.2014	19.06.2017	24 202 029		-	100.000	100.000	19.06.	4.921	N
Underlying Tracker on CS Group N	CHF	25.75	17.06.2015	19.06.2017	20 277 087		-	100.000	100.000		0.000	Y
4 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.06.2015	19.06.2017	26 388 832		-	100.000	100.000	19.06.	0.000	N
6 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.06.2015	19.06.2017	26 388 845		-	100.000	100.000	19.06.	0.76135	N
Underlying Tracker auf UBS N	CHF	1'000.00	24.09.2015	23.06.2017	26 388 881		-	100.000	100.000		0.000	Y
Bonus-Zertifikat on Nestle N	CHF	69.50	26.06.2014	26.06.2017	24 202 040		-	99.790	100.000		0.000	Y
7 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.06.2016	29.06.2017	32 848 185		-	100.000	100.000	29.06.	0.000	N
5.4 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	30.06.2016	30.06.2017	31 852 091		-	100.000	100.000	30.06.	0.000	N
4.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.07.2015	03.07.2017	26 388 838		-	100.000	100.000	03.01. 03.07.	0.000 0.000	Y
4 % Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	10.07.2015	10.07.2017	26 388 852		-	100.000	100.000	10.01. 10.07.	0.80084 0.82578	N
3 1/4 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	10.07.2015	10.07.2017	26 388 851		-	100.000	100.000	10.01. 10.07.	0.000 0.000	N
12.29 % Reverse Convertible 2016-10.07.17 on Generali	EUR	1'000.00	09.01.2017	10.07.2017	33 271 227		-	100.000	100.000	10.07.	0.000	Y
7.9 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	12.07.2016	12.07.2017	31 852 157		-	100.000	100.000	12.01. 12.07.	0.000 0.000	N
6.85 % Reverse Convertible on Galenica N	CHF	10'000.00	14.07.2016	14.07.2017	31 852 161		-	100.000	100.000	16.01. 14.07.	0.000 0.000	N
6.01 % Reverse Convertible on Deutsche Post N	EUR	1'000.00	16.01.2017	17.07.2017	33 271 303		-	100.000	100.000	17.07.	0.000	Y
15.67 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.01.2017	17.07.2017	33 271 309		-	100.000	100.000	17.07.	0.000	Y
6 1/2 % Reverse Convertible on 10Y USD Swap Rate	USD	1'000.00	22.07.2016	21.07.2017	33 029 556		-	100.000	100.000	23.01. 21.07.	3.665 3.419	N
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.07.2015	24.07.2017	27 036 636		-	100.000	100.000	24.01. 24.07.	0.000 0.000	N
21.12 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.01.2017	24.07.2017	34 960 149		-	100.000	100.000	24.07.	6.500	Y
9 1/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.07.2016	27.07.2017	32 848 093		-	100.000	100.000	27.01. 27.07.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on The Swatch Grp	CHF	292.00	07.06.2016	07.08.2017	31 852 064		-	100.000	100.000		0.000	Y
8.63 % Reverse Convertible on Commerzbank I	EUR	1'000.00	06.02.2017	07.08.2017	34 960 350		-	100.000	100.000	07.08.	0.000	Y
Protection Participation on Equities	EUR	1'000.00	09.05.2016	09.08.2017	30 689 233		-	95.000	95.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Helvetia Hldg N	CHF	541.00	10.08.2015	10.08.2017	20 277 089		-	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	EUR	1'000.00	10.05.2016	10.08.2017	30 689 235		-	95.000	95.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	EUR	1'000.00	10.05.2016	10.08.2017	30 689 234		-	95.000	95.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.08.2016	14.08.2017	32 848 095		-	100.000	100.000	13.02. 14.08.	0.000 0.000	N
5.99 % Reverse Convertible on Celgene Corp Rg	USD	1'000.00	13.02.2017	14.08.2017	35 383 550		-	100.000	100.000	14.08.	6.720	Y
6.01 % Reverse Convertible on Essilor Intl P	EUR	1'000.00	13.02.2017	14.08.2017	35 383 534		-	100.000	100.000	14.08.	0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Schneider Electric	EUR	1'000.00	13.02.2017	14.08.2017	35 383 536		-	100.000	100.000	14.08.	0.000	Y
13.13 % Reverse Convertible on UniCredit Nm	CHF	1'000.00	13.02.2017	14.08.2017	35 383 548		-	100.000	100.000	14.08.	0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Assicuraz General N	EUR	1'000.00	13.02.2017	14.08.2017	35 383 533		-	100.000	100.000	14.08.	0.000	Y
6.5 % Reverse Convertible on Henkel Vz I	EUR	1'000.00	13.02.2017	14.08.2017	35 383 535		-	100.000	100.000	14.08.	0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
6.3 % Reverse Convertible on The Swatch Grp	CHF	1'000.00	16.08.2016	16.08.2017	31 852 190		-	100.000	100.000	16.02. 16.08.	0.000 0.000	N
8.15 % Reverse Convertible on UBS Group N	CHF	1'000.00	16.08.2016	16.08.2017	31 852 191		-	100.000	100.000	16.02. 16.08.	0.000 0.000	N
11.6 % Reverse Convertible on Hess Rg	USD	50'000.00	18.05.2017	18.08.2017	36 465 330		-	100.000	100.000	18.08.	147.86	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.08.2015	21.08.2017	27 981 909		-	100.000	100.000	24.02. 21.08.	0.000 0.000	N
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.08.2015	21.08.2017	27 981 907		-	100.000	100.000	24.02. 21.08.	0.000 0.000	N
8.68 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.02.2017	21.08.2017	34 960 111		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
11.28 % Reverse Convertible on ams I	CHF	1'000.00	21.02.2017	21.08.2017	35 383 779		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Bayer N	EUR	1'000.00	19.05.2017	21.08.2017	36 597 712		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Carrefour P	EUR	1'000.00	19.05.2017	21.08.2017	36 597 715		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	19.05.2017	21.08.2017	36 597 714		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Amazon.Com Rg	USD	1'000.00	19.05.2017	21.08.2017	36 597 716		-	100.000	100.000	21.08.	3.060	Y
7.8 % Reverse Convertible on Intesa Sanpaolo N	EUR	1'000.00	22.02.2017	22.08.2017	35 383 817		-	100.000	100.000	22.08.	0.000	Y
12.06 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.02.2017	22.08.2017	35 383 780		-	100.000	100.000	22.08.	6.720	Y
7.54 % Reverse Convertible on Intesa Sanpaolo N	EUR	1'000.00	22.02.2017	22.08.2017	35 383 795		-	100.000	100.000	22.08.	0.000	Y
8.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.05.2017	22.08.2017	36 597 783		-	100.000	100.000	22.08.	0.000	Y
8.8 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.05.2017	22.08.2017	36 597 786		-	100.000	100.000	22.08.	3.030	Y
5 % Reverse Convertible on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	23.08.2016	23.08.2017	31 852 194		-	100.000	100.000	23.02. 23.08.	0.000 0.000	N
5.7 % Reverse Convertible on Straumann Hldg N	CHF	1'000.00	23.08.2016	23.08.2017	31 852 196		-	100.000	100.000	23.02. 23.08.	0.000 0.000	N
5.7 % Reverse Convertible on Galenica N	CHF	5'000.00	23.08.2016	23.08.2017	31 852 193		-	100.000	100.000	23.02. 23.08.	0.000 0.000	N
6.26 % Reverse Convertible on American Intl Gr Rg	USD	1'000.00	23.02.2017	23.08.2017	35 383 814		-	100.000	100.000	23.08.	6.750	Y
5 % Reverse Convertible on Celgene Corp Rg	EUR	1'000.00	23.02.2017	23.08.2017	35 383 842		-	100.000	100.000	23.08.	0.000	Y
12.56 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.02.2017	24.08.2017	35 383 898		-	100.000	100.000	24.08.	0.000	Y
6.4 % Reverse Convertible Called for red.on 27.02.17 at 100 % 27.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	26.05.2016	28.08.2017	30 689 256		-	100.000	100.000	27.02.	0.000	N
6.65 % Reverse Convertible on Indices 27.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	26.05.2016	28.08.2017	30 689 257		-	100.000	100.000	27.02.	0.000	N
5.5 % Reverse Convertible on AXA P	EUR	1'000.00	27.02.2017	28.08.2017	35 383 919		-	100.000	100.000	28.08.	0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Lvmh	EUR	1'000.00	27.02.2017	28.08.2017	35 383 917		-	100.000	100.000	28.08.	0.000	Y
7.6 % Reverse Convertible on Barrick Gold Rg	USD	1'000.00	27.02.2017	28.08.2017	35 383 915		-	100.000	100.000	28.08.	6.710	Y
5 % Reverse Convertible on Volkswagen Vz I	EUR	1'000.00	27.02.2017	28.08.2017	35 383 916		-	100.000	100.000	28.08.	0.000	Y
6.29 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.02.2017	28.08.2017	35 383 918		-	100.000	100.000	28.08.	6.710	Y
7.86 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.08.2016	29.08.2017	33 640 882		-	100.000	100.000	28.02. 29.08.	0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	04.09.2015	04.09.2017	27 981 978		-	100.000	100.000	06.03. 06.06. 04.09.	0.000 0.000 0.000	N
7.4 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.09.2016	04.09.2017	32 848 105		-	100.000	100.000	02.03. 04.09.	0.000 0.000	N
6.45 % Reverse Convertible on Unilever Cert	EUR	1'000.00	02.03.2017	04.09.2017	35 656 247		-	100.000	100.000	04.09.	0.000	Y
5.48 % Reverse Convertible on Nike -B-	USD	1'000.00	02.09.2016	05.09.2017	33 640 934		-	100.000	100.000	02.03. 02.09.	4.801 4.617	Y
8.3 % Reverse Convertible on Alexion Pharm Rg	USD	1'000.00	02.03.2017	05.09.2017	35 656 251		-	100.000	100.000	05.09.	7.050	Y
6.47 % Reverse Convertible on Delta Air Lines Rg	USD	1'000.00	03.03.2017	05.09.2017	35 656 276		-	100.000	100.000	05.09.	7.010	Y
4.59 % Reverse Convertible on Colgate-Palmolive	USD	50'000.00	03.03.2017	05.09.2017	35 656 274		-	100.000	100.000	05.09.	350.75	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	8'626.34	09.09.2015	08.09.2017	20 277 094		-	100.000	100.000		0.000	Y
3.93 % Reverse Convertible on Allianz N	EUR	10'000.00	09.09.2016	11.09.2017	33 765 203		-	100.000	100.000	09.03. 11.09.	0.000 0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
10.9 % Reverse Convertible on Bank of America Rg	USD	1'000.00	09.03.2017	11.09.2017	35 656 520		-	100.000	100.000	11.09.	7.130	Y
9.3 % Reverse Convertible on Alibaba Grp Sp ADS	USD	1'000.00	09.03.2017	11.09.2017	35 656 521		-	100.000	100.000	11.09.	7.130	Y
9.5 % Reverse Convertible on Celgene Corp Rg	USD	1'000.00	09.03.2017	11.09.2017	35 656 519		-	100.000	100.000	11.09.	7.130	Y
4.87 % Reverse Convertible on Altria Group Rg	USD	1'000.00	10.03.2017	11.09.2017	35 656 549		-	100.000	100.000	11.09.	7.140	Y
7.48 % Reverse Convertible on Facebook-A	USD	1'000.00	10.03.2017	11.09.2017	35 656 550		-	100.000	100.000	11.09.	7.140	Y
8 3/4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.09.2016	12.09.2017	32 848 114		-	100.000	100.000	09.03. 12.09.	4.971 4.780	N
5.9 % Reverse Convertible on Sunrise Comm	CHF	1'000.00	13.09.2016	13.09.2017	33 225 765		-	100.000	100.000	13.03. 13.09.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on The Swatch Grp	CHF	367.60	14.03.2016	14.09.2017	20 277 103		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Swiss Re N	CHF	89.75	14.03.2016	14.09.2017	20 277 104		-	100.000	100.000		0.000	Y
15 1/2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.09.2016	15.09.2017	32 848 108		-	100.000	100.000	15.03. 15.09.	0.000 0.000	N
15.61 % Reverse Convertible on Equities	EUR	50'000.00	16.03.2017	18.09.2017	35 877 628		-	100.000	100.000	18.09.	0.000	Y
16.51 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.03.2017	18.09.2017	35 877 651		-	100.000	100.000	18.09.	0.000	Y
19.61 % Reverse Convertible on Petroleo Br Sp ADR	USD	1'000.00	17.03.2017	18.09.2017	35 877 653		-	100.000	100.000	18.09.	7.193	Y
5.15 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.09.2016	20.09.2017	33 891 192		-	100.000	100.000	20.09.	0.000	Y
4.65 % Reverse Convertible on Emmi N	CHF	1'000.00	20.09.2016	20.09.2017	31 852 216		-	100.000	100.000	20.03. 20.09.	0.000 0.000	N
6.61 % Reverse Convertible on GAM Hldg N	EUR	1'000.00	22.09.2016	22.09.2017	33 891 225		-	100.000	100.000	22.03. 22.09.	0.000 0.000	Y
6 3/4 % Reverse Convertible on Equities 22.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	22.09.2016	22.09.2017	33 029 652		-	100.000	100.000	22.03. 22.06.	0.000 0.000	N
5.4 % Reverse Convertible on ING Group	EUR	1'000.00	22.09.2016	22.09.2017	33 891 224		-	100.000	100.000	22.03. 22.09.	0.000 0.000	Y
5.2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.09.2014	25.09.2017	24 603 117		-	100.000	100.000	27.03. 25.09.	1.560 1.649	N
5.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	25.09.2014	25.09.2017	24 603 116		-	100.000	100.000	25.03. 25.09.	0.14916 0.150	N
5.22 % Reverse Convertible on Equities	USD	50'000.00	23.03.2017	25.09.2017	35 877 803		-	100.000	100.000	25.09.	367.90	Y
3.13 % Reverse Convertible on S&P 500	USD	1'000.00	23.03.2017	25.09.2017	35 877 808		-	100.000	100.000	25.09.	7.350	Y
9.11 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.03.2017	25.09.2017	35 877 834		-	100.000	100.000	25.09.	7.310	Y
12.03 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.03.2017	25.09.2017	35 877 835		-	100.000	100.000	25.09.	7.310	Y
8.83 % Reverse Convertible on Gilead Sciences Rg	USD	1'000.00	24.03.2017	25.09.2017	35 877 843		-	100.000	100.000	25.09.	7.310	Y
7.86 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.03.2017	25.09.2017	35 877 836		-	100.000	100.000	25.09.	7.310	Y
16.56 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.09.2016	26.09.2017	33 891 285		-	100.000	100.000	27.03. 26.09.	7.866 15.530	Y
7 1/2 % Reverse Convertible on Novo Nordisk -B-	CHF	1'000.00	03.10.2016	03.10.2017	34 076 744		-	100.000	100.000	03.04. 03.10.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	08.10.2014	10.10.2017	24 202 127		-	99.909	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Richemont N	CHF	65.55	11.03.2016	11.10.2017	20 277 102		-	100.000	100.000		0.000	Y
6.15 % Reverse Convertible on Adecco Group N	CHF	1'000.00	11.10.2016	11.10.2017	33 225 787		-	100.000	100.000	11.04. 11.10.	0.000 0.000	N
JB Conditional Capital Protection Cert. with credit risk	EUR	100'000.00	12.10.2012	12.10.2017	19 330 443		-	87.650	100.000		0.000	Y
8.46 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.10.2016	20.10.2017	34 162 314		-	100.000	100.000	20.04. 20.10.	0.000 0.000	N
6.7 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.10.2016	20.10.2017	33 225 679		-	100.000	100.000	20.04. 20.10.	0.000 0.000	N
7.42 % Reverse Convertible on BNP Paribas-A-	EUR	1'000.00	21.04.2017	23.10.2017	36 057 955		-	100.000	100.000	23.10.	0.000	Y
11.04 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	21.04.2017	23.10.2017	36 057 960		-	100.000	100.000	23.10.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-23.10.17 (Exp.19.10.17) on EUR/USD	EUR	1'000.00	21.07.2017	23.10.2017	37 332 545		-	100.000	100.000	23.10.	0.000	Y
4.65 % Reverse Convertible on Lindt&Spruengli PS	CHF	10'000.00	25.10.2016	25.10.2017	33 225 795		-	100.000	100.000	25.04. 25.10.	0.000 0.000	N
6.9 % Reverse Convertible on Geberit N	CHF	1'000.00	25.10.2016	25.10.2017	33 225 796		-	100.000	100.000	25.04. 25.10.	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	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
11 1/2 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.10.2016	27.10.2017	33 225 678		-	100.000	100.000	27.04. 27.10.	7.957 7.995	N
9 3/4 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.10.2016	30.10.2017	33 225 673		-	100.000	100.000	28.04. 30.10.	0.000 0.000	N
8.05 % Reverse Convertible on Facebook-A	USD	1'000.00	28.04.2017	30.10.2017	36 295 509		-	100.000	100.000	30.10.	7.320	Y
8.17 % Reverse Convertible on Wells Fargo Rg	USD	1'000.00	28.04.2017	30.10.2017	36 295 507		-	100.000	100.000	30.10.	7.320	Y
8.03 % Reverse Convertible on Facebook-A	USD	1'000.00	28.04.2017	30.10.2017	36 295 511		-	100.000	100.000	30.10.	7.320	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.11.2016	03.11.2017	33 225 675		-	100.000	100.000	06.02. 04.05. 04.08. 03.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
11.89 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.05.2017	06.11.2017	36 295 716		-	100.000	100.000	06.11.	0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.03.2017	07.11.2017	35 877 884		-	100.000	100.000	07.11.	0.000	Y
Credit Linked-Cert. with credit risk	EUR	100'000.00	02.05.2013	13.11.2017	20 966 526		-	92.283	100.000		0.000	Y
9.27 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.05.2017	13.11.2017	36 465 134		-	100.000	100.000	13.11.	7.510	Y
10.7 % Reverse Convertible on Equities 22.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	20.05.2016	20.11.2017	30 856 974		-	100.000	100.000	22.05.	0.000	N
5.15 % Reverse Convertible on Indices 2.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	02.09.2016	20.11.2017	33 029 607		-	100.000	100.000	02.03. 02.06.	0.000 0.000	N
11.14 % Reverse Convertible on Tesla Rg	USD	1'000.00	19.05.2017	20.11.2017	36 597 743		-	100.000	100.000	20.11.	7.480	Y
5 % Reverse Convertible on Siemens N	EUR	1'000.00	19.05.2017	20.11.2017	36 597 713		-	100.000	100.000	20.11.	0.000	Y
17.24 % Reverse Convertible on Freeport McMoRan Rg	USD	1'000.00	19.05.2017	20.11.2017	36 597 752		-	100.000	100.000	20.11.	7.480	Y
9.15 % Reverse Convertible on Burckhardt Compre N	CHF	1'000.00	21.11.2016	21.11.2017	33 225 826		-	100.000	100.000	22.05. 21.11.	0.000 0.000	N
6.00 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.11.2016	24.11.2017	33 225 714		-	100.000	100.000	24.05. 24.11.	0.000 0.000	N
8.6 % Reverse Convertible on Equities 2.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	02.12.2016	01.12.2017	34 480 788		-	100.000	100.000	02.03.	0.000	N
8.3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	31.05.2017	01.12.2017	36 464 958		-	100.000	100.000	01.12.	0.000	Y
8.2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	31.05.2017	01.12.2017	36 464 956		-	100.000	100.000	01.12.	0.000	Y
8.8 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.05.2017	01.12.2017	36 464 955		-	100.000	100.000	01.12.	7.140	Y
10.45 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	31.05.2017	01.12.2017	36 464 957		-	100.000	100.000	01.12.	0.000	Y
10.01 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.06.2017	04.12.2017	36 803 067		-	100.000	100.000	04.12.	0.000	Y
6.19 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.06.2017	04.12.2017	36 598 139		-	100.000	100.000	04.12.	7.380	Y
5.85 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	05.12.2016	05.12.2017	34 557 039		-	100.000	100.000	06.06. 05.12.	0.000 0.000	N
7.47 % Reverse Convertible on ING Group Rg	EUR	1'000.00	26.05.2017	06.12.2017	36 597 894		-	100.000	100.000	06.12.	0.000	Y
8.3 % Reverse Convertible on Sunrise Comm	CHF	1'000.00	07.12.2016	07.12.2017	33 225 849		-	100.000	100.000	07.06. 07.12.	0.000 0.000	N
5.25 % Reverse Convertible on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	07.12.2016	07.12.2017	33 225 850		-	100.000	100.000	07.06. 07.12.	0.000 0.000	N
7.2 % Reverse Convertible on VAT Group N	CHF	1'000.00	07.12.2016	07.12.2017	33 225 848		-	100.000	100.000	07.06. 07.12.	0.000 0.000	N
10.39 % Reverse Convertible on Credit Agricole	EUR	1'000.00	26.05.2017	07.12.2017	36 597 897		-	100.000	100.000	07.12.	0.000	Y
9.25 % Reverse Convertible on Apple Rg	USD	1'000.00	06.06.2017	07.12.2017	36 803 108		-	100.000	100.000	07.12.	7.400	Y
10.9 % Reverse Convertible on Alibaba Grp Sp ADS	USD	1'000.00	06.06.2017	07.12.2017	36 803 106		-	100.000	100.000	07.12.	7.400	Y
Protection Participation on Equities	EUR	1'000.00	10.03.2017	11.12.2017	34 960 123		-	90.000	90.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	10.03.2017	11.12.2017	34 960 124		-	88.967	90.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	CHF	1'000.00	10.03.2017	11.12.2017	34 960 122		-	90.000	90.000		0.000	Y
10.1 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.04.2017	11.12.2017	36 057 615		-	100.000	100.000	11.12.	0.000	Y
6.48 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.04.2017	11.12.2017	36 057 614		-	100.000	100.000	11.12.	0.000	Y
9.96 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	10.04.2017	11.12.2017	36 057 613		-	100.000	100.000	11.12.	0.000	Y
7.51 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.04.2017	11.12.2017	36 057 616		-	100.000	100.000	11.12.	0.000	Y
5.28 % Reverse Convertible on Gilead Sciences Rg	USD	1'000.00	09.06.2017	11.12.2017	36 803 222		-	100.000	100.000	11.12.	7.430	Y
Underlying Tracker on Helvetia Hldg N	CHF	474.00	10.12.2014	12.12.2017	20 277 078		-	99.909	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
10 % Reverse Convertible on Equities 15.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	15.12.2016	15.12.2017	34 480 812		-	100.000	100.000	15.03. 15.06. 15.09.	4.233 4.094 4.033	N
3.5 % Reverse Convertible on ABB N	CHF	1'000.00	15.06.2016	18.12.2017	31 852 057		-	100.000	100.000	15.06. 18.12.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on ABB N	CHF	19.73	20.06.2016	20.12.2017	31 852 074		-	100.000	100.000		0.000	Y
7.58 % Reverse Convertible on Credit Agricole	EUR	1'000.00	21.04.2017	20.12.2017	36 057 956		-	100.000	100.000	20.12.	0.000	Y
11 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.12.2016	21.12.2017	33 225 732		-	100.000	100.000	21.06. 21.12.	8.236 16.710	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	21.03.2017	21.12.2017	34 960 501		-	88.867	90.000		0.000	Y
7.17 % Reverse Convertible on Swiss Re N	CHF	1'000.00	24.04.2017	28.12.2017	36 295 292		-	100.000	100.000	28.12.	0.000	Y
7.4 % Reverse Convertible on Julius Baer Grp N	CHF	1'000.00	29.12.2016	29.12.2017	33 225 859		-	100.000	100.000	29.06. 29.12.	0.000 0.000	N
11.29 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.05.2017	29.12.2017	36 465 328		-	100.000	100.000	29.12.	9.660	Y
9.8 % Reverse Convertible on Banco Santander Rg	EUR	1'000.00	26.05.2017	29.12.2017	36 597 898		-	100.000	100.000	29.12.	0.000	Y
11.21 % Reverse Convertible on Societe Generale	EUR	1'000.00	26.05.2017	29.12.2017	36 597 896		-	100.000	100.000	29.12.	0.000	Y
8.38 % Reverse Convertible on UniCredit N	EUR	1'000.00	26.05.2017	29.12.2017	36 597 899		-	100.000	100.000	29.12.	0.000	Y
11.1 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.06.2017	29.12.2017	36 465 363		-	100.000	100.000	29.12.	7.300	Y
11.8 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.06.2017	29.12.2017	36 465 362		-	100.000	100.000	29.12.	7.300	Y
6.19 % Reverse Convertible on Alphabet Rg-A	USD	50'000.00	06.07.2017	08.01.2018	37 140 645	%	99.800	100.000	100.000		0.000	Y
9.01 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.07.2017	08.01.2018	37 140 799	%	100.000	100.000	100.000		0.000	Y
12.95 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.07.2017	08.01.2018	37 140 700	%	100.050	100.000	100.000		0.000	Y
4.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.01.2015	15.01.2018	25 998 369	%	99.900	100.000	100.000	16.01. 17.07.	0.000 0.000	N
8 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.07.2017	15.01.2018	37 140 970	%	100.000	100.000	100.000		0.000	Y
4.38 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	14.07.2017	15.01.2018	37 141 073	%	99.900	100.000	100.000		0.000	Y
10.15 % Reverse Convertible on ArcelorMittal Rg	USD	1'000.00	13.07.2017	16.01.2018	37 141 028	%	99.800	100.000	100.000		0.000	Y
4.49 % Reverse Convertible on Amazon.Com Rg	USD	5'000.00	14.07.2017	16.01.2018	37 141 077	%	99.600	100.000	100.000		0.000	Y
9 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.01.2017	18.01.2018	33 271 333	%	100.050	100.000	100.000		0.000	Y
10.3 % Reverse Convertible on Tesla Motors	USD	1'000.00	19.01.2017	19.01.2018	33 225 954	%	100.250	100.000	100.000	19.07.	8.254	N
5.4 % Reverse Convertible on CS Group N	CHF	1'000.00	20.06.2017	19.01.2018	36 967 561	%	99.950	100.000	100.000		0.000	Y
5.03 % Reverse Convertible on Adecco Group N	CHF	1'000.00	20.06.2017	19.01.2018	36 967 560	%	99.950	100.000	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.07.2017	22.01.2018	36 803 400	%	96.200	100.000	100.000		0.000	Y
9.57 % Reverse Convertible on Equities	USD	50'000.00	21.07.2017	22.01.2018	37 332 400	%	96.600	100.000	100.000		0.000	Y
5.5 % Reverse Convertible on Ascom Hldg N	CHF	1'000.00	24.01.2017	24.01.2018	33 225 989	%	100.200	100.000	100.000	24.07.	0.000	N
4.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.01.2017	26.01.2018	33 226 033	%	100.300	100.000	100.000		0.000	Y
9.11 % Reverse Convertible on Equities	USD	50'000.00	28.07.2017	29.01.2018	37 332 618	%	95.700	100.000	100.000		0.000	Y
7.16 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.07.2017	29.01.2018	37 332 651	%	99.950	100.000	100.000		0.000	Y
4.7 % Reverse Convertible on Novartis N	CHF	1'000.00	07.02.2017	07.02.2018	33 225 997	%	100.350	100.000	100.000	07.08.	0.000	N
Protection Participation on BGF GI All A2C	USD	1'000.00	17.02.2015	16.02.2018	26 388 753	%	109.250	91.498	95.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible Called for red. On 16.08.17 at 100 % 16.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	16.02.2017	16.02.2018	33 226 072		-	100.000	100.000	16.05. 16.08.	0.000 0.000	N
12.04 % Reverse Convertible on JC Penney Rg	USD	1'000.00	17.08.2017	20.02.2018	37 512 042	%	86.550	100.000	100.000		0.000	Y
5.9 % Reverse Convertible on Emmi N	CHF	1'000.00	21.02.2017	21.02.2018	33 226 018	%	100.750	100.000	100.000	21.08.	0.000	N
11.2 % Reverse Convertible Called for red.on 23.08.17 at 100 % 23.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	23.02.2017	23.02.2018	34 960 097		-	100.000	100.000	23.05. 23.08.	0.000 0.000	N
7.5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.08.2017	26.02.2018	37 684 243	%	88.300	100.000	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.08.2017	26.02.2018	37 684 252	%	96.900	100.000	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.08.2017	27.02.2018	37 140 783	%	98.450	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
6.1 % (6.1 % p.a.) Reverse Convertible on Indices 2.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	02.12.2016	02.03.2018	34 480 740		-	100.000	100.000	02.03. 02.06.	0.000 0.000	N
Protection Participation on BXIIMR5E Index	EUR	10'000.00	04.03.2015	05.03.2018	26 388 775	%	95.550	94.573	95.000		0.000	Y
4.2 % Reverse Convertible on Geberit N	CHF	1'000.00	07.03.2017	07.03.2018	33 271 045	%	100.400	100.000	100.000	07.09.	0.000	N
20.33 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.09.2017	12.03.2018	37 905 438	%	95.850	100.000	100.000		0.000	Y
8.57 % Reverse Convertible on ArcelorMittal Rg	EUR	1'000.00	11.09.2017	12.03.2018	37 905 445	%	100.950	100.000	100.000		0.000	Y
13.49 % Reverse Convertible on Micron Technolog Rg	USD	1'000.00	11.09.2017	12.03.2018	37 905 431	%	101.400	100.000	100.000		0.000	Y
4.42 % Reverse Convertible on Fedex Rg	USD	1'000.00	11.09.2017	12.03.2018	37 905 446	%	99.950	100.000	100.000		0.000	Y
3.1 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.03.2015	19.03.2018	26 388 788	%	100.450	100.000	100.000	18.09.	0.000	Y
11.73 % Reverse Convertible on Alibaba Grp Sp ADS	USD	1'000.00	18.09.2017	19.03.2018	38 091 578	%	97.750	100.000	100.000		0.000	Y
9.05 % Reverse Convertible on Amazon.Com Rg	USD	5'000.00	18.09.2017	19.03.2018	38 091 577	%	100.800	100.000	100.000		0.000	Y
7.25 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.03.2017	23.03.2018	35 383 506	%	101.000	100.000	100.000	25.09.	0.000	N
10.4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.03.2017	23.03.2018	35 383 510	%	101.700	100.000	100.000	25.09.	0.000	N
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	260.20	11.03.2015	03.04.2018	20 277 085	CHF	290.750	99.969	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	78.90	01.06.2016	03.04.2018	31 852 049	CHF	82.350	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on E.ON N	EUR	5.77	30.12.2016	03.04.2018	33 225 945	CHF	7.740	100.000	100.000		0.000	Y
8.9 % Reverse Convertible on GAM Hldg N	CHF	1'000.00	04.04.2017	04.04.2018	33 271 076	%	102.200	100.000	100.000	04.10.	0.000	N
4.7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	05.10.2016	06.04.2018	32 848 125	%	101.150	100.000	100.000	05.04. 05.10.	0.000 0.000	N
2.1 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	05.10.2016	06.04.2018	32 848 124	%	100.150	100.000	100.000	05.04. 05.10.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	226.40	06.12.2016	09.04.2018	33 225 844	CHF	252.500	100.000	100.000		0.000	Y
6.55 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.07.2017	13.04.2018	37 141 054	%	100.600	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on BXIIMR5E-Index	EUR	100'000.00	27.04.2015	27.04.2018	26 388 809	%	95.300	94.738	95.000		0.000	Y
7.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.11.2016	02.05.2018	33 225 687	%	100.400	100.000	100.000	02.02. 02.05. 02.08. 02.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
8.7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.05.2017	02.05.2018	35 877 975	%	101.700	100.000	100.000	02.11.	0.000	N
Capital Protection Cert. on Barclays US Q-MA ER-Index	USD	100'000.00	07.05.2013	03.05.2018	20 966 527	%	89.420	86.330	90.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur GrpN	CHF	254.00	21.10.2016	07.05.2018	33 225 798	CHF	293.750	100.000	100.000		0.000	Y
6.33 % Reverse Convertible on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	23.10.2017	08.05.2018	38 464 508	%	99.450	100.000	100.000		0.000	Y
8.3 % Reverse Convertible on Equities 9.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	09.05.2016	09.05.2018	30 689 227		-	100.000	100.000	09.02. 09.05.	0.000 0.000	N
12.73 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.11.2017	11.05.2018	38 842 707	%	85.500	100.000	100.000		0.000	Y
11.79 % Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	13.11.2017	14.05.2018	38 842 755	%	99.900	100.000	100.000		0.000	Y
9.41 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.11.2017	14.05.2018	38 842 752	%	97.900	100.000	100.000		0.000	Y
11.14 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.11.2017	14.05.2018	38 842 753	%	97.400	100.000	100.000		0.000	Y
10.02 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.11.2017	14.05.2018	38 842 754	%	96.850	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	75.45	14.03.2017	15.05.2018	33 271 062	CHF	87.550	100.000	100.000		0.000	Y
5.81 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.08.2017	16.05.2018	37 512 029	%	100.100	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	17.12.2014	17.05.2018	24 202 182	CHF	1148.000	99.454	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	73.40	17.11.2016	18.05.2018	33 225 824	CHF	86.800	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	68.90	17.11.2016	18.05.2018	33 225 825	CHF	90.950	100.000	100.000		0.000	Y
17.09 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	22.05.2018	38 842 985	%	88.950	100.000	100.000		0.000	Y
8.19 % Reverse Convertible on Amazon.Com Rg	USD	5'000.00	20.11.2017	22.05.2018	38 842 990	%	100.200	100.000	100.000		0.000	Y
5.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	21.11.2017	22.05.2018	38 843 008	%	90.700	100.000	100.000		0.000	Y
8.75 % Reverse Convertible on Amazon.Com Rg	USD	5'000.00	21.11.2017	22.05.2018	38 843 048	%	100.400	100.000	100.000		0.000	Y
7.56 % Reverse Convertible on Wells Fargo Rg	USD	1'000.00	21.11.2017	22.05.2018	38 843 057	%	101.550	100.000	100.000		0.000	Y
11.89 % Reverse Convertible on Celgene Corp Rg	USD	1'000.00	21.11.2017	22.05.2018	38 843 044	%	100.550	100.000	100.000		0.000	Y
8.65 % Reverse Convertible on Facebook-A Rg	USD	1'000.00	21.11.2017	22.05.2018	38 843 058	%	98.750	100.000	100.000		0.000	Y
4.5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.11.2017	22.05.2018	38 843 009	%	97.500	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Alphabet Rg-A	USD	5'000.00	21.11.2017	22.05.2018	38 843 055	%	100.050	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	25.08.2017	25.05.2018	37 684 256	%	99.300	100.000	100.000		0.000	Y
2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	25.08.2017	25.05.2018	37 684 255	%	99.550	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Royal Dutch Shell-A	EUR	21.58	27.02.2017	29.05.2018	34 960 040	CHF	28.370	100.000	100.000		0.000	Y
6.92 % Reverse Convertible on Facebook-A Rg	USD	1'000.00	27.11.2017	29.05.2018	39 014 647	%	98.800	100.000	100.000		0.000	Y
8.82 % Reverse Convertible on Celgene Corp Rg	USD	1'000.00	27.11.2017	29.05.2018	39 014 639	%	100.100	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Obligationen	EUR	100.00	03.06.2015	01.06.2018	26 388 828	%	87.850	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	CHF	1'000.00	05.06.2017	05.06.2018	35 383 674	%	101.550	90.000	90.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	05.06.2017	05.06.2018	36 057 738	%	102.950	88.426	90.000		0.000	Y
Protection Participation on JB Mco S Inc EURBC	EUR	100'000.00	08.06.2015	08.06.2018	26 388 833	%	95.400	93.547	94.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Swiss Re N	CHF	89.90	18.04.2017	08.06.2018	35 383 640	CHF	91.400	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	08.06.2017	08.06.2018	36 464 971	%	101.100	93.624	95.000		0.000	Y
Protection Participation on S&P 500	USD	1'000.00	08.06.2017	08.06.2018	36 295 771	%	103.250	93.375	95.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	08.06.2017	08.06.2018	36 295 695	%	100.250	93.339	95.000		0.000	Y
9.85 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.06.2017	14.06.2018	36 464 978	%	101.800	100.000	100.000	14.12.	0.000	N
4.3 % Reverse Convertible on Volkswagen Vz I	EUR	1'000.00	15.06.2017	15.06.2018	36 295 762	%	101.350	100.000	100.000	15.12.	0.000	N
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	15.06.2015	18.06.2018	20 277 086	CHF	1029.000	100.000	100.000		0.000	Y
4.73 % Reverse Convertible on Siemens N	EUR	100'000.00	20.12.2017	27.06.2018	38 464 406	%	99.550	100.000	100.000		0.000	Y
5.91 % Reverse Convertible on adidas N	EUR	100'000.00	20.12.2017	27.06.2018	38 464 405	%	99.050	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	CHF	1'000.00	28.09.2017	28.06.2018	37 332 686	%	98.550	100.000	100.000		0.000	Y
7.35 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.06.2016	29.06.2018	32 260 815		-	100.000	100.000	29.03. 29.06.	0.000 0.000	N
29.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
11 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.12.2017	06.07.2018	39 218 518	%	99.200	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	07.07.2017	09.07.2018	36 464 923	CHF	996.880	98.275	100.000		0.000	Y
4.34 % Reverse Convertible on Unilever Cert	EUR	100'000.00	27.12.2017	09.07.2018	38 464 416	%	99.150	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	10.04.2017	10.07.2018	34 960 076	CHF	1172.490	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	252.90	14.07.2016	16.07.2018	31 852 168	CHF	270.750	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Swisscom N	CHF	471.60	14.07.2016	16.07.2018	31 852 169	CHF	540.000	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Indices	EUR	10'000.00	17.10.2017	17.07.2018	37 332 700	%	99.040	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	23.12.2016	23.07.2018	33 225 736	CHF	1336.310	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	82.35	29.07.2016	30.07.2018	31 852 180	CHF	87.300	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Indices	EUR	1'000.00	02.11.2017	02.08.2018	37 684 449	%	98.550	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Indices	CHF	1'000.00	02.11.2017	02.08.2018	37 684 448	%	97.900	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Givaudan N	CHF	1'727.00	13.02.2017	13.08.2018	33 226 013	CHF	2215.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	73.95	14.02.2017	14.08.2018	33 226 019	CHF	83.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	237.41	15.02.2017	15.08.2018	33 271 034	CHF	253.500	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	75.40	17.02.2017	17.08.2018	33 271 037	CHF	83.650	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	22.11.2017	22.08.2018	38 464 313	%	98.850	93.949	100.000		0.000	Y
7.75 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.08.2017	24.08.2018	37 140 770	%	100.750	100.000	100.000	24.11.	0.000	N
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	242.50	26.08.2016	27.08.2018	31 852 207	CHF	250.500	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	242.50	26.08.2016	27.08.2018	31 852 206	CHF	256.750	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Swisscom N	CHF	452.20	01.03.2017	29.08.2018	33 271 050	CHF	513.500	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	240.90	02.09.2016	04.09.2018	31 852 200	CHF	255.000	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	06.11.2017	06.09.2018	38 464 280	%	98.450	88.766	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.09.2017	11.09.2018	37 905 448	%	99.350	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	03.10.2016	03.10.2018	33 740 144	CHF	1364.390	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	76.10	03.10.2016	03.10.2018	33 225 782	CHF	83.400	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on The Swatch Grp I	CHF	349.90	04.04.2017	05.10.2018	35 383 628	CHF	396.250	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	CHF	1'000.00	13.10.2017	12.10.2018	37 684 423	%	98.450	100.000	100.000		0.000	Y
5.25 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.11.2016	16.11.2018	33 225 684	%	103.150	100.000	100.000	16.11.	0.000	N
3.50 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	25.11.2016	26.11.2018	33 225 703		-	100.000	100.000	27.02. 26.05. 25.08. 27.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
27.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	27.11.2017	27.11.2018	38 091 836	%	97.900	93.347	95.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	27.11.2017	27.11.2018	38 091 834	%	100.400	93.347	95.000		0.000	Y
8.55 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.05.2017	30.11.2018	36 464 939	%	99.150	100.000	100.000	30.11.	0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.12.2016	03.12.2018	34 480 760	%	106.800	100.000	100.000	02.03. 02.06. 05.09. 04.12.	2.391 2.280 2.967 2.677	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
3.05 % Reverse Convertible on Indices 5.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	05.12.2016	05.12.2018	33 226 025		-	100.000	100.000	06.03. 06.06. 06.09. 05.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
4.25 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	14.12.2016	14.12.2018	33 225 717	%	102.600	100.000	100.000	14.12.	0.000	N
Credit Linked Note (exp.21.12.18) on JP Morgan Chase	USD	100'000.00	26.11.2013	28.12.2018	22 756 897	%	101.400	92.700	100.000		0.000	Y
Credit Linked Note floating rate note with credit risk	USD	100'000.00	06.12.2013	28.12.2018	22 756 918	%	112.980	86.871	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	3'650.27	03.11.2017	28.12.2018	37 905 332	CHF	4132.960	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on LandisGyr Gr N	CHF	65.85	09.10.2017	10.01.2019	37 511 571	CHF	67.250	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.966%	USD	1'000.00	27.07.2017	29.01.2019	36 803 412		-	97.699	100.000		0.000	Y
8.5 % Reverse Convertible Called for red.on 08.09.17 at 100% 8.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.03.2017	08.03.2019	34 960 129		-	100.000	100.000	08.06. 08.09.	0.000 0.000	N
GAIN on Fund Basket	USD	10'000.00	09.02.2009	15.03.2019	4 966 205	%	97.560	72.800	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Allianz N	EUR	170.25	28.03.2017	28.03.2019	35 383 969	CHF	226.540	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	3'059.77	31.03.2016	29.03.2019	20 277 105	CHF	4132.960	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	73.75	04.04.2017	04.04.2019	35 383 627	CHF	80.900	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	253.10	04.04.2017	04.04.2019	35 383 629	CHF	249.600	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.10.2017	10.04.2019	37 684 428	%	100.300	97.523	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.10.2017	10.04.2019	37 684 427	%	100.300	97.537	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	13.04.2017	15.04.2019	34 960 083	CHF	984.210	96.871	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	256.40	18.04.2017	15.04.2019	35 383 639	CHF	245.100	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	78.80	16.06.2017	16.04.2019	36 295 708	CHF	81.150	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.10.2017	17.04.2019	37 684 446	%	92.750	97.480	100.000		0.000	Y
Guaranteed Alternative Investment Notes (GAIN) (exp.29.3.19) on a Basket of Funds	JPY	1'000'000.00	09.02.2009	19.04.2019	2 561 777	%	94.190	88.600	100.000		0.000	Y
Principal Protected Notes on Basket	USD	100'000.00	09.02.2012	19.04.2019	14 820 697	%	95.580	88.788	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.10.2017	24.04.2019	38 091 794	%	93.850	97.476	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	27.04.2017	30.04.2019	35 383 977	CHF	992.010	96.999	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	09.11.2016	09.05.2019	34 205 449	CHF	1206.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Swiss Re N	CHF	83.35	15.09.2017	23.05.2019	37 332 268	CHF	89.550	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	83.40	29.05.2017	29.05.2019	36 057 746	CHF	83.150	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	259.90	09.06.2016	07.06.2019	31 852 058	CHF	263.250	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	08.06.2017	11.06.2019	35 656 199	CHF	1139.140	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	14.06.2017	14.06.2019	36 464 892	CHF	941.830	97.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CS Group N	CHF	13.18	21.06.2017	21.06.2019	36 465 244	CHF	17.150	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	21.06.2017	21.06.2019	36 464 899	CHF	942.310	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	251.90	22.06.2017	24.06.2019	36 295 706	CHF	245.600	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	251.90	22.06.2017	24.06.2019	36 295 705	CHF	235.600	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.06.2017	24.06.2019	36 967 680	%	102.250	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	28.12.2016	28.06.2019	33 225 937	CHF	1296.520	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	01.07.2016	01.07.2019	31 852 154	CHF	1179.000	100.000	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible on Indices 4.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	04.07.2016	04.07.2019	32 260 817		-	100.000	100.000	04.01. 04.04. 04.07.	0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	247.50	05.08.2016	05.08.2019	31 852 187	CHF	261.250	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Helvetia Hldg N	CHF	553.00	10.08.2017	12.08.2019	36 803 298	CHF	530.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Deutsche Bank N	EUR	15.64	11.08.2017	12.08.2019	36 598 162	CHF	18.310	100.000	100.000		0.000	Y
Kapitalschutz-Zertifikat on Equities	USD	1'000.00	03.09.2014	03.09.2019	24 202 095	%	111.200	91.646	100.000		0.000	Y
Capital Protection-Cert. on Equities	USD	1'000.00	10.09.2014	10.09.2019	24 202 089	%	100.400	91.917	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	10'000.00	15.09.2017	16.09.2019	37 905 520	%	98.600	92.176	95.000		0.000	Y
Protection Participation on S&P 500	USD	10'000.00	15.09.2017	16.09.2019	37 905 517	%	103.790	92.176	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.09.2017	20.09.2019	37 332 698	%	92.700	96.899	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.10.2017	04.10.2019	37 684 413	%	100.150	96.598	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	100.00	17.10.2016	17.10.2019	33 740 193	CHF	132.920	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	08.11.2016	08.11.2019	33 225 885	CHF	1302.370	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	11.11.2016	11.11.2019	33 226 023	%	101.450	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.11.2017	14.11.2019	38 464 290	%	101.550	96.425	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	235.60	17.11.2016	18.11.2019	33 225 828	CHF	250.750	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	20.11.2019	38 464 293	%	100.050	96.337	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	13.12.2017	13.12.2019	37 905 355	CHF	950.110	96.132	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on ABB N	CHF	25.85	21.12.2017	23.12.2019	38 464 562	CHF	25.900	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	27.12.2016	27.12.2019	33 225 938	CHF	1130.390	94.941	100.000		0.000	Y
Protection Participation on BGF GI All A2C	USD	1'000.00	17.02.2015	18.02.2020	26 388 752	%	103.070	92.070	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	07.03.2017	06.03.2020	33 271 051	CHF	1076.000	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.03.2017	16.03.2020	34 960 488	%	103.250	94.391	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Pimco GIS-Income	USD	10'000.00	17.03.2017	17.03.2020	35 656 427	%	101.110	90.929	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	250.10	28.03.2017	30.03.2020	33 271 064	CHF	245.500	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Pimco GIS-Income	USD	10'000.00	07.04.2017	07.04.2020	35 877 812	%	100.400	94.760	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	257.90	12.04.2017	15.04.2020	35 383 635	CHF	248.300	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	246.00	01.07.2016	21.04.2020	31 852 153	CHF	263.250	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Pimco GIS-IncomeFund	USD	10'000.00	25.04.2017	27.04.2020	36 295 310	%	100.020	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	79.35	17.05.2017	18.05.2020	35 383 671	CHF	80.600	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	07.06.2017	09.06.2020	36 295 693	CHF	1006.000	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	21.06.2017	22.06.2020	36 465 343		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	22.12.2017	22.06.2020	38 668 561	CHF	1152.010	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.07.2017	13.07.2020	36 803 379	%	101.300	99.941	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.07.2017	13.07.2020	36 803 380	%	101.200	94.776	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.07.2017	13.07.2020	36 803 374	%	98.550	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.07.2017	13.07.2020	36 803 373	%	99.100	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.07.2017	13.07.2020	36 803 375	%	95.950	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.07.2017	20.07.2020	36 803 394	%	101.700	94.941	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.07.2017	20.07.2020	36 803 392	%	98.800	99.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	24.07.2017	24.07.2020	36 803 403		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	03.08.2017	03.08.2020	37 140 749		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.08.2017	07.08.2020	37 140 758	%	95.350	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	14.08.2017	14.08.2020	37 140 766		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.08.2017	17.08.2020	37 140 768	%	100.450	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 16.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	17.08.2017	17.08.2020	37 140 767		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	17.08.2017	17.08.2020	37 140 774		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.08.2017	17.08.2020	37 140 773	%	99.300	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	8'941.62	08.09.2017	08.09.2020	36 967 929	CHF	9055.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	15.09.2017	15.09.2020	37 332 669	CHF	1016.000	100.000	100.000		0.000	Y
Notes on Basket	JPY	10'000.00	10.05.2010	18.09.2020	11 298 164	%	99.500	87.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	12.10.2017	12.10.2020	37 684 437	%	99.100	97.327	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	19.10.2017	19.10.2020	37 141 022	CHF	1112.810	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Indices	USD	10'000.00	17.10.2017	20.10.2020	38 091 770	%	98.300	95.209	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Indices	USD	1'000.00	02.11.2017	02.11.2020	37 684 450	%	97.700	94.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.11.2017	02.11.2020	38 091 811	%	94.550	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.11.2017	17.11.2020	38 668 532	%	100.800	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.11.2017	20.11.2020	38 091 838	%	100.300	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	22.11.2017	23.11.2020	38 464 301	%	101.400	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	22.11.2017	23.11.2020	38 464 312	%	97.500	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.11.2017	24.11.2020	38 464 316	%	98.050	94.309	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	14.12.2017	14.12.2020	38 668 551	%	99.300	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	19.12.2017	21.12.2020	38 464 404	CHF	1136.800	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	20.12.2017	21.12.2020	24 341 810	%	98.800	93.873	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	20.12.2017	21.12.2020	24 341 809	%	98.650	93.872	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Basket	USD	100'000.00	20.05.2016	28.06.2021	30 689 244	%	106.830	94.071	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Basket	USD	100'000.00	20.05.2016	28.06.2021	30 689 243	%	103.520	94.071	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf S&P 500 Index	USD	100'000.00	31.05.2016	28.06.2021	32 519 299	%	107.510	93.491	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Basket	NZD	150'000.00	29.06.2016	13.10.2021	32 836 242	%	110.860	88.162	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Basket	USD	100'000.00	15.10.2015	29.12.2025	26 388 895	%	99.270	22.618	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Basket	USD	100'000.00	21.06.2016	29.12.2025	32 836 217	%	105.560	86.171	100.000		0.000	Y
Bank J. Safra Sarasin Ltd, Guernsey Branch, St Peter Port, Guernsey												
8 1/2 % Reverse Convertible 2015-06.01.17 on Equities	CHF	1'000.00	06.01.2016	06.01.2017	29 183 967		-	98.467	100.000	06.01.	0.000	Y
4 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	16.01.2015	16.01.2017	26 172 819		-	100.000	100.000	16.01.	0.000	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
8 % Reverse Convertible on Crude Oil Barrel	USD	1'000.00	22.07.2016	24.01.2017	32 409 647		-	100.000	100.000	24.01.	5.200	Y
Reverse Convertible on Marks&Spencer	GBP	1'000.00	28.07.2015	30.01.2017	27 743 307		-	98.472	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.08.2015	13.02.2017	27 743 340		-	100.000	75.915	13.02.	1.587	N
6.15 % Multi Barrier Reverse Convertibles on Equities	CHF	1'000.00	14.02.2014	14.02.2017	23 115 793		-	100.000	100.000	14.02.	0.47658	N
Reverse Convertible on Henkel Vz	EUR	96.00	14.01.2016	14.02.2017	29 183 977		-	99.999	100.000		0.000	Y
11.4 % Reverse Convertible on Equities	EUR	100.00	22.02.2016	22.02.2017	29 184 022		-	100.000	100.000	22.02.	0.000	N
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.09.2016	07.03.2017	32 409 723		-	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.03.2015	20.03.2017	26 172 848		-	100.000	100.000	20.03.	0.000	N
Underlying Tracker on Apple	USD	125.90	27.03.2015	27.03.2017	26 172 861		-	98.350	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Berkshire Hathawy-B	USD	145.53	27.03.2015	27.03.2017	26 172 862		-	98.350	100.000		0.000	Y
11 % Reverse Convertible on Allergan	USD	1'000.00	28.12.2016	28.03.2017	34 259 098		-	100.000	100.000	28.03.	2.530	Y
14.5 % Reverse Convertible on Facebook-A	USD	1'000.00	30.12.2016	30.03.2017	34 259 103		-	100.000	100.000	30.03.	2.620	Y
Reverse Convertible on Credit Suisse	USD	1'000.00	31.03.2016	31.03.2017	29 184 072		-	98.767	100.000		0.000	Y
Outperformance Bonus Certificates on SMI	CHF	1'000.00	04.04.2014	04.04.2017	23 115 837		-	99.552	100.000		0.000	Y
8.2 % Reverse Convertible on Tesla Motors	USD	1'000.00	12.08.2016	07.04.2017	32 409 676		-	100.000	100.000	07.04.	8.330	Y
6.3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.05.2015	04.05.2017	26 172 895		-	100.000	100.000	04.05.	0.000	N
8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.05.2015	04.05.2017	26 172 890		-	100.000	100.000	06.02. 04.05.	0.000 0.000	N
7.65 % Reverse Convertible on Deutsche Bk Mex 11	MXN	50'000.00	11.05.2016	11.05.2017	29 184 108		-	100.000	100.000	11.05.	203.10	Y
11.48 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.05.2015	15.05.2017	26 172 902		-	100.000	100.000	15.02. 15.05.	0.00002 0.00002	N
12.8 % Reverse Convertible on Equities 13.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	13.05.2016	15.05.2017	29 184 111		-	100.000	100.000	13.02.	0.000	N
Underlying Tracker on ING Group	EUR	1'000.00	19.11.2015	19.05.2017	29 183 931		-	100.000	100.000		0.000	Y
9.1 % Reverse Convertible on Apple	USD	1'000.00	24.05.2016	24.05.2017	29 184 121		-	100.000	100.000	24.05.	12.270	Y
6.4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.11.2015	29.05.2017	29 183 899		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	N
7.65 % Reverse Convertible on Deutsche Bk Mex 11	MXN	50'000.00	31.05.2016	31.05.2017	29 184 130		-	100.000	100.000	31.05.	125.11	Y
5 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.06.2016	07.06.2017	32 409 566		-	100.000	100.000	07.06.	0.000	Y
4.65 % Reverse Convertible on USSW10	CHF	5'000.00	20.06.2016	20.06.2017	32 409 588		-	100.000	100.000	20.06.	0.000	N
5 % Reverse Convertible on Equities 30.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.06.2016	30.06.2017	32 409 605		-	100.000	100.000	30.03. 30.03.	0.000 0.000	N
Outperformance Bonus Certificates on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	04.07.2014	04.07.2017	24 192 539		-	98.844	100.000		0.000	Y
9.3 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.07.2016	05.07.2017	32 409 612		-	100.000	100.000	05.07.	0.000	Y
4 % Reverse Convertible on Indices 10.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	10.07.2015	10.07.2017	28 197 968		-	100.000	100.000	10.04.	0.000	N
5 % Reverse Convertible on Indices 10.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.07.2016	10.07.2017	32 409 621		-	100.000	100.000	10.01.	0.000	N
9 % Reverse Convertible on CS Group N 13.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	13.07.2016	13.07.2017	32 409 626		-	100.000	100.000	13.01.	0.000	N
5.35 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.07.2016	14.07.2017	32 409 616		-	100.000	100.000	14.07.	0.000	Y
6 3/4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.07.2016	14.07.2017	32 409 615		-	100.000	100.000	14.07.	11.960	Y
8 1/2 % Reverse Convertible on u-blox Hldg N	CHF	1'000.00	14.07.2016	14.07.2017	32 409 629		-	100.000	100.000	16.01. 14.07.	0.000 0.000	N
6.4615 % (6.461538 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.06.2016	17.07.2017	32 409 581		-	100.000	100.000	17.07.	0.000	Y
7.7214 % (7.721448 % p.a.) Reverse Convertible on Axa	EUR	1'000.00	22.07.2016	21.07.2017	32 409 646		-	100.000	100.000	21.07.	0.000	Y
8.1226 % (8.122563 % p.a.) Reverse Convertible on Volkswagen Vz	EUR	1'000.00	22.07.2016	21.07.2017	32 409 645		-	100.000	100.000	21.07.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.07.2015	27.07.2017	27 743 305		-	100.000	100.000	27.01. 27.04. 27.07.	0.00002 0.00002 0.00002	N
6.8 % Reverse Convertible on Alstom 27.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.01.2016	27.07.2017	29 183 987		-	100.000	100.000		0.000	N
Reverse Convertible on Roche Hldg G	EUR	225.00	29.06.2016	31.07.2017	32 409 606		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	890.00	04.02.2016	04.08.2017	29 183 998		-	100.000	100.000		0.000	Y
9.2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	09.08.2016	09.08.2017	32 409 660		-	100.000	100.000	09.02. 09.08.	0.000 0.000	N
7.9 % Reverse Convertible on Deutsche Bk Mex 11	MXN	50'000.00	16.08.2016	16.08.2017	32 409 681		-	100.000	100.000	16.08.	142.43	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
7.55 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.08.2016	17.08.2017	32 409 686		-	100.000	100.000	17.02. 17.08.	0.000 0.000	N
6 % Reverse Convertible on Forbo Hldg N	CHF	2'000.00	21.06.2017	21.08.2017	36 030 870		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible on CieFinRichemont N	CHF	1'000.00	21.06.2017	21.08.2017	36 030 871		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
14.85 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.02.2017	23.08.2017	34 259 301		-	100.000	100.000	23.08.	0.000	Y
10 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.05.2016	28.08.2017	29 184 125		-	100.000	100.000	28.08.	0.000	Y
9.3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.08.2016	30.08.2017	32 409 704		-	100.000	100.000	02.03. 30.08.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Equiites 3.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	31.08.2016	31.08.2017	32 409 716		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.543%	USD	1'000.00	01.09.2015	01.09.2017	29 183 859		-	98.413	100.000	01.03.	0.000	Y
10 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	01.09.2016	01.09.2017	32 409 706		-	100.000	100.000	01.03. 01.09.	0.000 0.000	N
3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	05.03.2015	04.09.2017	26 172 836		-	100.000	100.000	06.03. 02.06. 04.09.	0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Barratt Dev PLC	GBP	1'000.00	07.03.2016	05.09.2017	29 184 051		-	98.718	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	06.09.2016	06.09.2017	32 409 719		-	100.000	100.000		0.000	Y
9.15 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	12.09.2016	12.09.2017	32 409 741		-	100.000	100.000	13.03. 12.09.	0.000 0.000	N
Protection Participation on USD/JPY	USD	1'000.00	19.09.2016	19.09.2017	32 409 756		-	96.517	98.000		0.000	Y
4.0111 % (4.011142 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.09.2016	22.09.2017	32 409 746		-	100.000	100.000	22.03. 22.09.	0.000 0.000	N
3 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	25.09.2015	25.09.2017	29 183 868		-	100.000	100.000	16.03. 16.06. 25.09.	0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible on EUR/USD	USD	1'000.00	22.08.2017	03.10.2017	36 031 026		-	100.000	100.000	03.10.	1.390	Y
Reverse Convertible on Axa	EUR	17.00	11.08.2016	11.10.2017	32 409 674		-	100.000	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities 7.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.10.2016	11.10.2017	33 985 371		-	100.000	100.000	06.01. 06.02. 07.03. 06.04. 05.05. 07.06.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
8 % Reverse Convertible on Equities 6.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.10.2016	11.10.2017	33 985 370		-	100.000	100.000	06.01. 06.02. 07.03. 06.04.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Equities 12.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	12.10.2016	12.10.2017	33 985 393		-	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible 2017-16.10.17 (Exp.09.10.17) on Geberit N	CHF	1'000.00	16.08.2017	16.10.2017	36 030 993		-	100.000	100.000	16.10.	0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	PLN	1'000.00	20.10.2015	20.10.2017	28 198 023		-	91.886	95.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	21.04.2016	20.10.2017	29 184 095		-	98.437	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 23.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	20.10.2016	20.10.2017	34 258 907		-	98.407	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.10.2016	27.10.2017	34 258 911		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.10.2016	27.10.2017	34 258 909		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.10.2016	27.10.2017	34 258 908		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.10.2016	27.10.2017	34 258 912		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	17.11.2016	17.11.2017	34 258 962		-	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities 28.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	28.11.2016	28.11.2017	34 258 980		-	100.000	100.000	29.05. 28.11.	0.000 0.000	N
9 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.01.2017	11.12.2017	34 259 111		-	100.000	100.000	11.12.	0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 20.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	19.12.2016	19.12.2017	34 259 027		-	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities 22.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	23.12.2016	22.12.2017	34 259 052		-	100.000	100.000	22.03.	0.000	N
9.4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.03.2017	27.12.2017	36 030 598		-	100.000	100.000	27.12.	0.000	Y
Reverse Convertible on Lloyds Banking Grp 5.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.915%	GBP	1'000.00	01.07.2016	04.01.2018	32 409 609		-	98.789	100.000		0.000	Y
7.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.07.2016	09.01.2018	32 409 613	%	99.630	100.000	100.000	10.01. 08.02. 08.03. 10.04. 09.05. 08.06. 10.07. 10.08. 10.09. 10.10. 10.11.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
4.3 % Reverse Convertible on Roche Holding	CHF	1'000.00	11.01.2016	11.01.2018	29 183 971	%	90.310	100.000	100.000	11.01. 11.04. 11.07. 11.10.	10.750 10.750 10.750 10.750	N
7 % Reverse Convertible on ISDAFIXUSD10Y	USD	100'000.00	25.04.2017	25.01.2018	36 030 696	%	98.350	100.000	100.000		0.000	Y
12.75 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.02.2017	01.02.2018	34 259 190	%	57.380	100.000	100.000		0.000	Y
5.15 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	01.02.2017	01.02.2018	34 259 191	%	100.440	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	08.08.2016	08.02.2018	32 409 667	%	100.660	99.034	100.000		0.000	Y
8.52 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.02.2017	09.02.2018	34 259 241	%	99.670	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	CHF	1'000.00	10.02.2017	12.02.2018	34 259 239	%	113.920	90.000	90.000		0.000	Y
Protection Participation on USD/RUB	USD	100'000.00	15.02.2017	15.02.2018	34 259 261	%	99.050	97.394	99.050		0.000	Y
Reverse Convertible on Vale Sp ADR	USD	1'000.00	17.02.2017	20.02.2018	34 259 278	%	125.580	98.295	100.000		0.000	Y
Protection Participation on USD/BRL	USD	100'000.00	21.02.2017	21.02.2018	34 259 280	%	96.790	97.540	99.200		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities 25.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	26.08.2016	26.02.2018	32 409 696		-	100.000	100.000	24.01. 23.02. 23.03. 24.04. 23.05. 23.06. 24.07. 23.08. 23.09.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
Protection Participation on USD/RUB	USD	50'000.00	27.02.2017	27.02.2018	34 259 305	%	98.480	96.361	98.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Heineken	EUR	69.00	15.12.2016	15.03.2018	34 259 047	CHF	79.570	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on USD/RUB	USD	100'000.00	15.03.2017	15.03.2018	34 259 337	%	98.950	96.308	98.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	20.03.2017	20.03.2018	36 030 576	%	100.340	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.12.2016	27.03.2018	34 259 096	%	101.750	100.000	100.000		0.000	Y
8.9 % Reverse Convertible on The Swatch Grp I	EUR	1'000.00	01.09.2017	27.04.2018	36 031 044	%	99.830	100.000	100.000		0.000	Y
7.8 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.04.2015	30.04.2018	26 172 883	%	99.320	97.059	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Crude Oil	USD	1'000.00	06.11.2017	07.05.2018	38 125 522	%	93.430	100.000	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	14.05.2013	14.05.2018	20 369 422	%	65.110	95.524	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Vodafone Group	GBP	1'000.00	16.11.2016	16.05.2018	34 258 965	%	102.050	98.885	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.11.2016	29.05.2018	34 258 997	%	102.500	97.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Vivendi 30.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	30.05.2016	30.05.2018	29 184 129		-	100.000	100.000		0.000	Y
5.3 % Reverse Convertible on Indices 30.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	30.11.2016	30.05.2018	34 259 002		-	100.000	100.000	30.05.	0.000	N
9 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.12.2016	12.06.2018	34 259 030	%	102.250	100.000	100.000	13.03. 12.06. 12.09. 12.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	18.06.2015	18.06.2018	28 197 957	%	122.420	100.000	100.000		0.000	Y
6.85 % Reverse Convertible on Vifor Pharma N	CHF	1'000.00	10.07.2017	10.07.2018	36 030 912	%	101.360	100.000	100.000		0.000	Y
2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.07.2015	16.07.2018	28 197 970	%	109.220	100.000	100.000	17.07.	0.000	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertibles on Equities	EUR	1'000.00	17.07.2015	17.07.2018	28 197 969	%	117.420	99.442	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	07.02.2017	07.08.2018	34 259 223		-	97.623	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Givaudan N	CHF	10'000.00	09.02.2017	09.08.2018	34 259 228	%	138.970	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	12.08.2015	13.08.2018	27 743 347		-	96.243	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 15.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	13.08.2015	13.08.2018	27 743 337		-	96.246	100.000		0.000	Y
Barrier Discount Certificates on Petroleo Br Sp ADR	USD	1'000.00	16.08.2013	16.08.2018	21 194 774	CHF	358.630	93.023	100.000		0.000	Y
Express Certificates on Cred.Agricole 18.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.667%	USD	1'000.00	18.08.2015	20.08.2018	27 743 344		-	96.295	100.000		0.000	Y
7.66 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.08.2017	22.08.2018	36 031 013	%	100.400	100.000	100.000	22.11.	0.000	N
0 % Reverse Convertible on Geberit N	CHF	1'000.00	23.08.2016	23.08.2018	32 409 699	%	83.680	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	970.00	24.02.2016	24.08.2018	29 184 032	CHF	950.530	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.02.2017	28.08.2018	34 259 309	%	103.250	97.560	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	07.09.2015	07.09.2018	28 198 018	%	118.570	100.000	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.09.2016	17.09.2018	32 409 754	CHF	1347.380	100.000	100.000	15.03.	0.000	Y
3.45 % (2.76 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.06.2017	19.09.2018	36 030 839	%	96.900	100.000	100.000		0.000	Y
10.25 % Reverse Convertible on Kroger Rg	USD	1'000.00	19.09.2017	19.09.2018	38 125 420	%	102.690	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.03.2017	28.09.2018	36 030 588	%	96.390	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.03.2017	28.09.2018	36 030 590	%	103.000	100.000	100.000		0.000	Y
5.1 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	04.04.2017	05.10.2018	36 030 614	%	100.010	100.000	100.000	05.10.	0.000	N
Reverse Convertible on Equities 13.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	13.04.2017	15.10.2018	36 030 664		-	100.000	100.000		0.000	Y
9.45 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.10.2017	17.10.2018	38 125 479	%	101.270	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on UBS Group N 18.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	18.10.2016	18.10.2018	34 258 899		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	18.04.2017	18.10.2018	36 030 671		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 20.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.155%	USD	1'000.00	20.04.2017	22.10.2018	36 030 694		-	97.545	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 15.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	14.11.2016	13.11.2018	34 258 952		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.598%	USD	1'000.00	28.11.2016	28.11.2018	34 258 993		-	97.455	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	12.12.2016	12.12.2018	34 259 033	%	118.980	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.06.2017	19.12.2018	36 030 809	%	99.690	97.606	100.000		0.000	Y
7.68 % Reverse Convertible on Equities 22.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.156%	USD	1'000.00	22.06.2015	24.12.2018	28 197 955		-	95.163	100.000		0.000	Y
Reverse Convertibles on Equities	USD	1'000.00	23.06.2015	24.12.2018	28 197 956	%	98.590	93.871	100.000		0.000	Y
3.15 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	28.12.2016	28.12.2018	34 259 015	%	-	100.000	100.000	28.03. 28.06. 28.09. 28.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
28.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung 28.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.07.2017	29.01.2019	36 030 961	%	101.940	100.000	100.000		0.000	Y
7.2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.08.2017	04.02.2019	36 030 969	%	98.620	100.000	100.000	02.11.	0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.08.2017	26.02.2019	36 031 007	%	103.780	97.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.18%	USD	1'000.00	03.09.2015	04.03.2019	29 183 850		-	95.683	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.09.2017	11.03.2019	38 125 384	%	102.040	97.569	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on iShs MSCI Br Cp	USD	1'000.00	06.12.2017	29.05.2019	38 125 583	%	100.360	97.195	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Petroleo Br Sp ADR	USD	1'000.00	01.12.2017	31.05.2019	38 125 568	%	101.090	97.191	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on iShs MSCI Br Cp	USD	1'000.00	07.12.2017	06.06.2019	38 125 589	%	100.490	97.156	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.06.2017	07.06.2019	36 030 793	%	104.000	96.971	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.06.2017	17.06.2019	36 030 813	%	87.010	97.047	100.000		0.000	N
Reverse Convertible on Equities 10.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.059%	USD	1'000.00	12.07.2017	10.07.2019	36 030 925		-	96.835	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.07.2016	15.07.2019	32 409 633	%	89.520	97.563	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CS Group N	CHF	1'000.00	20.01.2017	22.07.2019	34 259 158	%	113.630	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 25.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	25.07.2016	25.07.2019	32 409 652		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.07.2017	26.07.2019	36 030 942	%	98.430	96.884	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	05.08.2016	05.08.2019	32 409 666		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	05.08.2016	05.08.2019	32 409 665		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.08.2017	09.08.2019	36 030 975	%	103.530	96.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	05.09.2016	05.09.2019	32 409 722	%	66.480	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 5.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	05.09.2016	05.09.2019	32 409 724		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	05.09.2016	05.09.2019	32 409 725	%	102.880	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 30.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.049%	USD	1'000.00	06.03.2017	06.09.2019	34 259 320		-	96.102	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.09.2017	10.09.2019	38 125 392	%	65.890	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.09.2017	11.09.2019	36 031 043	%	99.490	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.09.2017	18.09.2019	38 125 415	%	102.750	97.041	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.09.2017	18.09.2019	38 125 413	%	96.950	97.041	100.000		0.000	Y
Protection Participation on USD/JPY	USD	50'000.00	24.03.2017	24.09.2019	36 030 600	%	97.190	95.683	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.09.2017	26.09.2019	38 125 424	%	102.750	96.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.09.2017	26.09.2019	38 125 423	%	96.630	96.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.10.2017	03.10.2019	38 125 445	%	96.570	96.771	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2016-07.10.19 on Equities 9.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.10.2016	07.10.2019	33 985 373		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	12.10.2017	11.10.2019	38 125 480	%	97.360	96.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.10.2016	28.10.2019	34 258 917	%	106.100	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.06.2017	09.12.2019	36 030 803	%	99.350	95.152	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.12.2017	12.12.2019	38 125 594	%	100.650	96.222	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	12.12.2017	13.12.2019	38 125 592	%	99.420	96.216	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.739%	USD	1'000.00	21.12.2016	23.12.2019	34 259 046		-	95.583	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	24.01.2017	27.01.2020	34 259 168		-	95.206	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.478%	USD	1'000.00	03.10.2016	02.04.2020	33 985 374		-	96.338	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.776%	USD	1'000.00	13.10.2016	13.04.2020	33 985 394		-	96.024	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.10.2016	21.04.2020	34 258 902	%	101.400	95.908	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.04.2017	27.04.2020	36 030 678	%	99.700	94.947	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.10.2016	28.04.2020	34 258 901	%	101.470	95.891	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.756%	USD	1'000.00	28.10.2016	04.05.2020	34 258 937		-	95.999	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.05.2017	12.05.2020	36 030 745	%	97.060	94.895	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.792%	USD	1'000.00	28.11.2016	28.05.2020	34 258 996		-	94.736	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.97%	USD	1'000.00	29.11.2016	29.05.2020	34 259 001		-	94.852	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 16.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	16.12.2016	16.06.2020	34 259 029		-	94.643	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.06.2017	16.06.2020	36 030 812	%	103.880	95.332	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.06.2017	16.06.2020	36 030 811	%	104.250	95.332	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.07.2017	20.07.2020	36 030 939	%	96.490	99.978	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	27.07.2016	27.07.2020	32 409 657		-	95.851	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.109%	USD	1'000.00	28.07.2016	28.07.2020	32 409 659		-	95.761	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.07.2017	28.07.2020	36 030 936	%	97.670	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.07.2017	28.07.2020	36 030 955	%	102.910	95.074	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.02.2017	06.08.2020	34 259 218		-	94.073	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.03.2017	22.09.2020	34 259 396	%	94.390	93.305	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 28.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.506%	USD	1'000.00	28.03.2017	28.09.2020	36 030 593		-	93.283	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.03.2017	28.09.2020	36 030 594	%	97.110	93.283	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	16.10.2017	16.10.2020	38 125 489	%	97.130	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.04.2017	20.10.2020	36 030 693	%	99.250	94.263	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.203%	USD	1'000.00	26.10.2016	26.10.2020	34 258 916		-	95.499	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.04.2017	26.10.2020	36 030 704	%	99.040	94.384	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.829%	USD	1'000.00	27.10.2016	27.10.2020	34 258 924		-	95.454	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 10.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.373%	USD	1'000.00	03.11.2016	06.11.2020	34 258 946		-	95.137	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.08%	USD	1'000.00	01.02.2017	01.02.2021	34 259 195		-	92.816	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.173%	USD	1'000.00	09.02.2017	09.02.2021	34 259 237		-	92.928	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 17.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	15.07.2016	15.07.2021	32 409 622		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 18.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	18.10.2016	18.10.2021	34 258 903		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	14.11.2016	15.11.2021	34 258 961	%	111.680	99.874	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Berkshire Hathawy-B	USD	166.62	21.12.2016	21.12.2021	34 259 074	CHF	175.870	90.930	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Apple	USD	115.19	21.12.2016	21.12.2021	34 259 072	CHF	157.650	90.930	100.000		0.000	Y
Bank of Scotland, Edinburgh, Grossbritannien												
(2 1/2 % min./10 % max.) Notes Variable Rate Reg-S Series EURO 0994/05	EUR	1'000.00	07.02.2005	07.02.2035	2 056 765	%	116.730	100.000	100.000	07.02.	36.032	N
Banque Cantonale Vaudoise Guernsey Branch, St-Peter Port, Guernsey												
9 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.01.2016	20.01.2017	30 978 850		-	100.000	100.000	20.01.	0.530	Y
7.2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.01.2016	25.01.2017	31 180 836		-	100.000	100.000	25.01.	0.530	Y
10.9 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.01.2016	26.01.2017	31 203 686		-	100.000	100.000	26.01.	0.530	Y
6.7 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.01.2016	27.01.2017	31 232 891		-	100.000	100.000	27.01.	0.530	Y
12 1/2 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.02.2016	02.02.2017	31 350 524		-	100.000	100.000	02.02.	11.370	Y
7.8 % (7.82 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.02.2016	02.02.2017	31 329 196		-	100.000	100.000	02.02.	0.210	Y
8 % (8.02 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.02.2016	10.02.2017	31 313 841		-	100.000	100.000	10.02.	0.000	Y
4 % (7.96 % p.a.) Reverse Convertible on UBS Group N	USD	1'000.00	12.08.2016	13.02.2017	33 571 454		-	100.000	100.000	13.02.	5.910	Y
20.2 % (20.26 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.02.2016	28.02.2017	31 696 096		-	100.000	100.000	28.02.	11.610	Y
12.9 % (8.6 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.09.2015	02.03.2017	29 463 353		-	100.000	100.000	02.03.	12.430	Y
8.6 % Reverse Convertible on Ingenico Group	EUR	1'000.00	03.03.2016	03.03.2017	31 715 515		-	100.000	100.000	03.03.	0.000	Y
11 1/2 % Reverse Convertible on Ingenico Group	EUR	1'000.00	03.03.2016	03.03.2017	31 715 516		-	100.000	100.000	03.03.	0.000	Y
Certificat Express on Funds	CHF	1'000.00	06.03.2014	06.03.2017	23 793 577		-	99.529	100.000		0.000	Y
6.9 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.03.2016	08.03.2017	31 787 773		-	100.000	100.000	08.03.	0.000	Y
6.8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.03.2016	08.03.2017	31 787 771		-	100.000	100.000	08.03.	0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.03.2016	08.03.2017	31 787 770		-	100.000	100.000	08.03.	0.000	Y
7 3/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.03.2016	08.03.2017	31 787 772		-	100.000	100.000	08.03.	0.000	Y
12.15 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.03.2016	24.03.2017	31 989 203		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
4 3/4 % Reverse Convertible on Equities	EUR	100.00	30.03.2016	30.03.2017	32 009 714		-	100.000	100.000	30.03.	0.000	Y
6.1 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.04.2016	07.04.2017	32 109 814		-	100.000	100.000	07.04.	12.180	Y
6 % (6.02 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	10'000.00	08.04.2016	07.04.2017	32 132 313		-	100.000	100.000	07.04.	121.47	Y
5.1 % (5.11 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.04.2016	07.04.2017	32 132 230		-	100.000	100.000	07.04.	12.150	Y
6.8 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.04.2016	11.04.2017	32 071 258		-	100.000	100.000	11.04.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.04.2016	11.04.2017	32 157 848		-	100.000	100.000	11.04.	12.170	Y
7 1/2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.04.2016	13.04.2017	32 079 556		-	100.000	100.000	13.04.	0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.04.2016	13.04.2017	32 079 555		-	100.000	100.000	13.04.	0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
8.4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.04.2016	14.04.2017	32 228 711		-	100.000	100.000	14.04.	12.010	Y
10.1 % (10.13 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.04.2016	19.04.2017	32 262 068		-	100.000	100.000	19.04.	0.000	Y
7.6 % Reverse Convertible on USD SWAP SEMI 30/360 10Y	USD	1'000.00	20.04.2016	20.04.2017	32 276 812		-	100.000	100.000	20.04.	12.040	Y
5 1/4 % Reverse Convertible on USD SWAP 10Y	EUR	1'000.00	21.04.2016	21.04.2017	32 284 707		-	100.000	100.000	21.04.	0.000	Y
5 3/4 % Reverse Convertible on USD SWAP 10Y	USD	1'000.00	21.04.2016	21.04.2017	32 284 706		-	100.000	100.000	21.04.	12.180	Y
5 3/4 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.04.2016	28.04.2017	32 278 150		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
6 3/4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.04.2016	28.04.2017	32 278 151		-	100.000	100.000	28.04.	12.140	Y
8.45 % (8.47 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.05.2016	09.05.2017	32 500 978		-	100.000	100.000	09.05.	12.330	Y
8.4 % (8.45 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.05.2016	15.05.2017	32 555 287		-	100.000	100.000	15.05.	12.080	Y
7.4 % (7.44 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.05.2016	15.05.2017	32 555 288		-	100.000	100.000	15.05.	0.000	Y
11 1/4 % Reverse Convertible on Apple	USD	1'000.00	18.05.2016	18.05.2017	32 582 590		-	100.000	100.000	18.05.	12.030	Y
7 3/4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.05.2016	18.05.2017	32 460 728		-	100.000	100.000	18.05.	12.030	Y
6 1/2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.05.2016	18.05.2017	32 460 729		-	100.000	100.000	18.05.	0.000	Y
7.4 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.11.2015	24.05.2017	30 487 710		-	100.000	100.000	24.05.	0.000	N
6 % (5.73 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.05.2016	26.05.2017	32 477 013		-	100.000	100.000	26.05.	12.530	Y
5.7 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.06.2016	01.06.2017	32 715 804		-	100.000	100.000	01.06.	12.690	Y
9.4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.06.2016	02.06.2017	32 729 200		-	100.000	100.000	02.06.	12.720	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.06.2015	06.06.2017	28 403 900		-	98.234	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.06.2015	08.06.2017	28 418 779		-	99.795	100.000		0.000	Y
7 1/4 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	09.06.2016	09.06.2017	32 723 635		-	100.000	100.000	09.06.	0.000	Y
Bonus-Zertifikat on ABB N	CHF	1.00	12.05.2014	13.06.2017	24 381 582		-	99.562	100.000		0.000	Y
8.52 % Reverse Convertible on USD SWAP SEMI 30/360 10Y	USD	1'000.00	17.06.2016	16.06.2017	32 859 493		-	100.000	100.000	16.06.	12.510	Y
7 % Reverse Convertible on USSW10	EUR	1'000.00	21.06.2016	21.06.2017	32 924 953		-	100.000	100.000	21.06.	0.000	Y
5.85 % Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	22.06.2016	22.06.2017	32 942 280		-	100.000	100.000	22.06.	0.000	Y
7 1/4 % Reverse Convertible on USSW10	USD	1'000.00	22.06.2016	22.06.2017	32 944 737		-	100.000	100.000	22.06.	6.076	N
6 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.06.2016	23.06.2017	32 786 056		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
5.05 % Reverse Convertible on 5.05% USSW10	USD	1'000.00	23.06.2016	23.06.2017	32 881 002		-	100.000	100.000	23.06.	12.400	Y
4 % Reverse Convertible on USSW10	EUR	1'000.00	05.07.2016	05.07.2017	33 079 373		-	100.000	100.000	05.07.	0.000	Y
4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.07.2016	05.07.2017	33 079 363		-	100.000	100.000	05.07.	11.590	Y
5.6 % Reverse Convertible on USSW10	USD	1'000.00	05.07.2016	05.07.2017	33 079 374		-	100.000	100.000	05.07.	11.590	Y
7 % Reverse Convertible on Indices 17.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	14.01.2015	14.07.2017	26 626 385		-	100.000	100.000	17.01.	5.113	N
12.1 % (12.13 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.07.2016	18.07.2017	33 279 114		-	100.000	100.000	18.07.	0.000	Y
5 1/4 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.07.2016	18.07.2017	33 279 122		-	100.000	100.000	18.07.	0.000	Y
10.44 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.07.2016	20.07.2017	33 292 713		-	100.000	100.000	20.01. 20.04. 20.07.	3.242 3.208 3.068	Y
7 % Reverse Convertible on Axa	EUR	1'000.00	08.08.2016	08.08.2017	33 418 935		-	100.000	100.000	08.08.	0.000	Y
7 1/2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.08.2016	08.08.2017	33 418 934		-	100.000	100.000	08.08.	0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.08.2016	18.08.2017	33 605 684		-	100.000	100.000	18.08.	14.520	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.08.2016	18.08.2017	33 564 321		-	100.000	100.000	18.08.	0.000	Y
7 1/2 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.08.2016	18.08.2017	33 564 322		-	100.000	100.000	18.08.	14.610	Y
6.4 % Reverse Convertible on Equities 20.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	20.08.2015	21.08.2017	29 266 894		-	100.000	100.000	20.02.	0.21288	N
8.3 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.09.2016	06.09.2017	33 790 099		-	100.000	100.000	06.09.	0.000	Y
6.3 % Reverse Convertible on IRS USD 10Y	USD	1'000.00	14.09.2016	14.09.2017	33 890 896		-	100.000	100.000	14.09.	15.080	Y
4.15 % Reverse Convertible on Indices 20.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	19.12.2014	19.09.2017	26 274 476		-	100.000	100.000	20.03.	0.66984	N
4 % Reverse Convertible on Pandora	EUR	1'000.00	21.09.2016	21.09.2017	33 982 873		-	100.000	100.000	21.09.	0.000	Y
3 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	22.09.2016	22.09.2017	33 840 756		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
3 % Reverse Convertible on Indices 30.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.09.2014	29.09.2017	25 420 205		-	100.000	100.000	30.03.	0.300	N
7 1/2 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.09.2016	29.09.2017	34 082 853		-	100.000	100.000	29.09.	15.190	Y
10.6 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.10.2016	05.10.2017	34 081 863		-	100.000	100.000	05.10.	0.000	Y
12.82 % (9.14 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	AUD	1'000.00	11.05.2016	06.10.2017	32 453 763		-	100.000	100.000	06.10.	23.790	Y
Protection du capital avec participation on Equities	USD	1'000.00	08.10.2013	09.10.2017	22 516 092		-	95.602	100.000		0.000	Y
8.05 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.10.2016	12.10.2017	34 215 987		-	100.000	100.000	12.10.	0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
6.2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.10.2016	26.10.2017	34 326 539		-	100.000	100.000	26.10.	0.000	Y
5 3/4 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.10.2016	27.10.2017	34 266 798		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
8 1/2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.10.2016	27.10.2017	34 343 901		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
4.40 % p.a. Reverse Convertible on Indices 28.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	30.04.2015	30.10.2017	27 848 375		-	100.000	100.000	28.04.	4.479	N
3.9 % Reverse Convertible on Indices 28.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	30.04.2015	30.10.2017	27 848 374		-	100.000	100.000	28.04.	0.4878	N
Protection Participation on Currencies	USD	1'000.00	03.11.2015	03.11.2017	30 238 415		-	93.617	95.000		0.000	Y
5.35 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.11.2016	03.11.2017	34 457 796		-	100.000	100.000	03.11.	0.000	Y
5.35 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.11.2016	03.11.2017	34 457 797		-	100.000	100.000	03.11.	0.000	Y
4 1/2 % (4.51 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.11.2016	03.11.2017	34 456 538		-	100.000	100.000	03.11.	0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	5'000.00	08.11.2016	08.11.2017	34 474 291		-	100.000	100.000	08.11.	0.000	Y
6.7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.11.2016	08.11.2017	34 514 471		-	100.000	100.000	08.11.	0.000	Y
6.6 % (8.8 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.02.2017	09.11.2017	35 610 820		-	100.000	100.000	09.11.	11.450	Y
7.00 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.11.2016	10.11.2017	34 552 945		-	100.000	100.000	10.11.	0.000	Y
6.50 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.11.2016	10.11.2017	34 552 946		-	100.000	100.000	10.11.	0.000	Y
5.50 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.11.2016	10.11.2017	34 552 948		-	100.000	100.000	10.11.	0.000	Y
6.50 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.11.2016	10.11.2017	34 552 947		-	100.000	100.000	10.11.	0.000	Y
7.00 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.11.2016	24.11.2017	34 706 335		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
8.75 % (8.77 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.11.2016	24.11.2017	34 718 654		-	100.000	100.000	24.11.	15.620	Y
8.10 % (8.36 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.12.2016	08.12.2017	34 983 273		-	100.000	100.000	08.12.	0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	22.08.2016	14.12.2017	33 640 774		-	98.421	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on E.ON N	EUR	1.00	14.09.2016	14.12.2017	33 891 443		-	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	5'000.00	24.01.2017	24.01.2018	35 342 956	%	104.610	100.000	100.000		0.000	Y
6.25 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.01.2017	26.01.2018	35 357 507	%	104.460	100.000	100.000		0.000	Y
4.6 % Reverse Convertible on Indices 6.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	05.02.2016	05.02.2018	31 053 531		-	100.000	100.000	06.02.	0.000	N
5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	09.02.2017	09.02.2018	35 483 842	%	101.450	100.000	100.000		0.000	Y
11.25 % (22.25 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.08.2017	19.02.2018	37 904 945	%	102.070	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	20.02.2015	20.02.2018	27 167 318	%	32.110	96.328	100.000		0.000	Y
4 1/2 % Reverse Convertible on Indices 25.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	25.08.2015	26.02.2018	29 198 448		-	100.000	100.000	27.02. 25.08.	0.69368 0.73957	N
4.7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.03.2017	08.03.2018	35 946 743	%	103.450	100.000	100.000		0.000	Y
5.35 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.03.2017	08.03.2018	35 946 744	%	104.180	100.000	100.000		0.000	Y
4.45 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.03.2017	08.03.2018	35 946 742	%	103.430	100.000	100.000		0.000	Y
5.65 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.04.2017	03.04.2018	36 244 538	%	102.220	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Fresenius Med Care	EUR	1.00	16.01.2017	16.04.2018	35 310 450	CHF	87.230	100.000	100.000		0.000	Y
5.5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.04.2017	25.04.2018	36 452 128	%	102.640	100.000	100.000		0.000	Y
5.7 % (5.72 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.05.2017	04.05.2018	36 579 209	%	92.430	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.05.2015	15.05.2018	28 201 886	%	62.330	99.435	100.000		0.000	Y
5.3 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.05.2017	15.05.2018	36 702 885	%	103.840	100.000	100.000		0.000	Y
5.5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.05.2017	18.05.2018	36 783 761	%	102.690	100.000	100.000		0.000	Y
7.25 % Reverse Convertible on Equities	EUR	10'000.00	07.06.2017	07.06.2018	37 014 235	%	82.360	100.000	100.000		0.000	Y
5.2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.06.2017	14.06.2018	37 012 458	%	96.740	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.06.2017	15.06.2018	37 094 060	%	104.390	100.000	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.06.2017	26.06.2018	37 224 520	%	101.090	100.000	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.06.2017	26.06.2018	37 227 076	%	101.700	100.000	100.000		0.000	Y
5.3 % Reverse Convertible on Equities	EUR	5'000.00	03.07.2017	03.07.2018	37 328 135	%	102.350	100.000	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.07.2017	13.07.2018	37 421 923	%	101.090	100.000	100.000		0.000	Y
6.62 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.08.2017	02.08.2018	37 601 793	%	102.650	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.08.2016	03.08.2018	33 450 780	%	99.010	98.150	100.000	03.11.	0.000	Y
4.25 % (5.67 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.11.2017	06.08.2018	38 953 995	%	103.000	100.000	100.000		0.000	Y
6.25 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.08.2017	31.08.2018	37 960 481	%	101.190	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	31.08.2017	31.08.2018	37 960 480	%	97.470	100.000	100.000		0.000	Y
8.2 % (10.93 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.12.2017	07.09.2018	39 429 283	%	101.050	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on USD/CNY	USD	1'000.00	15.09.2016	14.09.2018	33 901 144	%	96.870	94.128	96.000		0.000	Y
9.3 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.09.2017	20.09.2018	38 311 159	%	104.800	100.000	100.000		0.000	Y
5.05 % Reverse Convertible on Equities	EUR	10'000.00	25.09.2017	25.09.2018	38 398 133	%	101.460	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Envision Hlthcr Rg	USD	1'000.00	28.09.2017	28.09.2018	38 419 034	%	94.660	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.10.2016	05.10.2018	34 151 305	%	95.140	98.056	100.000	05.10.	0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 10.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.915%	EUR	1'000.00	08.10.2015	08.10.2018	29 965 630		-	99.685	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 10.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.812%	USD	1'000.00	08.10.2015	09.10.2018	29 965 631		-	97.051	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	EUR	1'000.00	10.10.2017	10.10.2018	38 382 646	%	100.310	95.000	95.000		0.000	Y
5.8 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.11.2017	06.11.2018	38 953 994	%	102.740	100.000	100.000		0.000	Y
5.9 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.11.2017	06.11.2018	38 953 993	%	103.130	100.000	100.000		0.000	Y
10.4 % Reverse Convertible on Netflix Rg	USD	1'000.00	13.11.2017	13.11.2018	39 034 735	%	101.230	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	EUR	10'000.00	14.11.2017	14.11.2018	39 101 500	%	100.830	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.09.2017	12.12.2018	38 205 257	%	101.200	98.047	100.000		0.000	Y
8.5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.12.2017	12.12.2018	39 460 870	%	100.900	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.01.2017	25.01.2019	35 382 348	%	80.710	97.104	100.000	25.07.	0.000	Y
12.4 % (8.75 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	AUD	1'000.00	18.10.2017	18.03.2019	38 582 466	%	100.090	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	03.05.2017	03.05.2019	36 578 891	%	107.700	96.590	100.000	03.11.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	02.08.2016	02.08.2019	33 403 129		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	28.10.2015	28.04.2020	30 202 071	%	123.920	98.766	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	21.06.2017	22.06.2020	37 031 019	%	137.260	100.000	100.000		0.000	Y
Barclays Bank PLC, London, Grossbritannien												
15.02 % Reverse Convertible on Telefonica	EUR	1'000.00	21.07.2016	23.01.2017	29 018 459		-	100.000	100.000	23.01.	0.02763	N
Notes on Index-Basket	USD	1'000.00	29.07.2015	27.01.2017	12 791 533		-	98.960	100.000		0.000	Y
(5 % max.) Barrier Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	31.01.2014	31.01.2017	22 905 895		-	99.170	100.000		0.000	Y
Regd.Bonus Certificate on FTSE 100 Index	GBP	1'000.00	05.02.2014	06.02.2017	12 029 121		-	96.000	100.000		0.000	Y
Barrier Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	06.02.2014	06.02.2017	22 905 919		-	97.530	100.000		0.000	Y
Capital Protected-Notes on USD/CNH	EUR	1'000.00	20.02.2014	20.02.2017	22 905 908		-	97.100	99.000		0.000	Y
Principal Protected Note on Basket	AUD	1'000.00	27.02.2014	20.02.2017	22 905 934		-	91.200	100.000		0.000	Y
8.92 % Reverse Convertible on Siemens N	EUR	1'000.00	19.07.2016	20.02.2017	29 018 438		-	100.000	100.000	19.01. 20.02.	0.05406 0.00933	N
Capped Outperformance Certificate on Roche Holding Ltd Shs	CHF	1'000.00	27.02.2015	27.02.2017	22 906 210		-	99.980	100.000		0.000	Y
Notes on Index-Basket	AUD	1'000.00	27.02.2015	27.02.2017	12 790 958		-	95.920	100.000		0.000	Y
0.63 % Autocallable Notes on Euro Stoxx 50-Index	CHF	1'000.00	06.03.2015	27.02.2017	12 790 968		-	100.000	100.000	27.02.	0.000	N
(2 3/4 % - 3.55 %) Step-up	EUR	1'000.00	28.02.2012	28.02.2017	11 862 572		-	100.000	100.000		0.000	N
Participation Notes on Euro Stoxx 50-Index	EUR	1'000.00	03.03.2014	03.03.2017	22 905 940		-	93.421	100.000		0.000	Y
Participation Note on Ibex 35-Index	EUR	1'000.00	03.03.2014	03.03.2017	22 905 941		-	93.421	100.000		0.000	Y
Autocallable Notes on Basket	EUR	1'000.00	04.03.2014	03.03.2017	12 029 313		-	98.200	100.000		0.000	Y
7.88 % Callable Notes on Index-Basket	CHF	1'000.00	18.09.2015	17.03.2017	28 421 425		-	100.000	100.000	17.03.	0.000	N
Principal Protected Note with Knock-Out on Euro Stoxx 50-Index	EUR	1'000.00	21.03.2013	21.03.2017	11 862 892		-	97.070	100.000		0.000	Y
1 % Kick-In GOAL on Euro Stoxx 50-Index	CHF	1'000.00	24.03.2015	24.03.2017	22 906 221		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	N
Autocallable Notes on Shares-Basket	CHF	1'000.00	24.03.2015	24.03.2017	27 154 225		-	100.000	100.000		0.000	Y
(no min.) Notes on BNP Paribas	EUR	1'000.00	28.03.2014	28.03.2017	12 029 393		-	98.330	100.000		0.000	Y
Notes on Shares-Basket	USD	1'000.00	01.04.2015	03.04.2017	12 791 070		-	98.380	100.000		0.000	Y
2 % Principal Protected Note on BC ComBATS VOLT ER-Index	AUD	1'000.00	10.04.2012	10.04.2017	11 862 654		-	99.778	113.000	10.04.	15.110	Y
Capital Protected Notes on Noble Multi Fund Basket of Index Reg-S	EUR	10'000.00	15.11.2004	18.04.2017	1 934 733		-	72.244	110.000		0.000	Y
4 % Kick-In GOAL on Euro Stoxx 50-Index	CHF	1'000.00	17.04.2015	18.04.2017	22 906 234		-	100.000	100.000	17.01. 18.04.	0.000 0.000	N
1 % Kick-In GOAL on Euro Stoxx 50-Index	EUR	1'000.00	17.04.2015	18.04.2017	22 906 235		-	100.000	100.000	17.01. 18.04.	0.32167 0.32052	N
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	29.04.2016	28.04.2017	26 829 331		-	94.825	96.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	EUR	1'000.00	05.08.2016	05.05.2017	26 829 357		-	94.000	94.000		0.000	Y
Bonus Certificate on a Basket of Indices	USD	1'000.00	07.05.2014	08.05.2017	22 906 017		-	96.910	100.000		0.000	Y
European Barrier Autocallable Notes VRN on Banco Santander SA Shs	EUR	1'000.00	14.05.2014	15.05.2017	12 029 571		-	98.210	100.000		0.000	Y
Perles Plus on S&P 500 Index	USD	1'000.00	21.02.2014	22.05.2017	22 905 938		-	97.570	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
European Barrier Autocallable Notes VRN on Banco Santander SA Shs	EUR	1'000.00	21.05.2014	22.05.2017	12 029 591		-	98.490	100.000		0.000	Y
1 % Kick-In GOAL on Euro Stoxx 50-Index	CHF	1'000.00	22.05.2015	22.05.2017	22 906 254		-	100.000	100.000	24.02. 22.05.	0.000 0.000	N
Notes on Shares-Basket	USD	1'000.00	27.05.2015	30.05.2017	12 791 296		-	98.360	100.000	30.05.		Y
Principal Protected Note on Basket	AUD	1'000.00	30.05.2014	31.05.2017	22 906 028		-	89.454	98.000		0.000	Y
7.15 % Reverse Convertible on Clariant Ag Series 181228	CHF	1'000.00	31.05.2016	31.05.2017	32 691 647		-	100.000	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	04.06.2014	06.06.2017	22 906 031		-	98.670	100.000		0.000	Y
8.93 % Reverse Convertible on AB InBev	EUR	1'000.00	08.11.2016	08.06.2017	34 015 549		-	100.000	100.000	08.05. 08.06.	0.05406 0.00921	N
(10 % max.) Notes on basket	EUR	1'000.00	10.06.2014	12.06.2017	12 790 565		-	98.600	100.000		0.000	Y
8.29 % Reverse Convertible on Fresenius Med Care	EUR	1'000.00	10.11.2016	12.06.2017	34 015 590		-	100.000	100.000	10.05. 12.06.	0.05435 0.00981	N
Worst-of Note on basket	USD	1'000.00	19.06.2014	19.06.2017	12 790 579		-	97.170	100.000		0.000	Y
Perles Plus on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	21.02.2014	21.06.2017	22 905 939		-	98.220	100.000		0.000	Y
8.05 % Reverse Convertible on AB InBev	EUR	1'000.00	22.11.2016	22.06.2017	34 015 735		-	100.000	100.000	22.05. 22.06.	0.05425 0.00921	N
8.05 % Reverse Convertible on AB InBev	EUR	1'000.00	22.11.2016	22.06.2017	34 015 736		-	100.000	100.000	22.05. 22.06.	0.05425 0.00921	N
(3 3/4 % Min.) Reverse Convertible Notes on Basket	USD	1'000.00	25.06.2014	26.06.2017	22 906 037		-	97.010	100.000		0.000	Y
Notes on Basket	EUR	1'000.00	27.06.2014	27.06.2017	12 790 586		-	98.840	100.000		0.000	Y
1 % Kick-In GOAL on Euro Stoxx 50-Index	CHF	1'000.00	02.07.2015	03.07.2017	22 906 265		-	100.000	100.000	03.01. 03.04. 03.07.	0.000 0.000 0.000	N
7.9 % (pro rata) Reverse Convertible on USD 10Y Swap Rate	USD	1'000.00	24.06.2016	03.07.2017	26 829 349		-	100.000	100.000	03.07.	5.430	Y
6.51 % Reverse Convertible on Richemont N	CHF	1'000.00	04.07.2016	04.07.2017	29 018 330		-	100.000	100.000	04.01. 04.07.	0.05041 0.04958	N
7.58 % Reverse Convertible on Fresenius Med Care	EUR	1'000.00	13.12.2016	13.07.2017	34 015 973		-	100.000	100.000	13.06. 13.07.	0.0541 0.00907	N
8.62 % Reverse Convertible on Airbus Group	EUR	1'000.00	21.06.2016	14.07.2017	29 018 255		-	100.000	100.000	21.06. 14.07.	0.10862 0.00696	N
5.98 % Reverse Convertible on BP	GBP	1'000.00	20.07.2016	20.07.2017	29 018 450		-	100.000	100.000	20.01. 20.07.	5.120 5.023	N
1 % (4 % P.A.) Issuer Ca1lable Notes Called for red.on 25.04.17 at 100% 25.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	21.07.2015	21.07.2017	12 791 531		-	100.000	100.000	24.01. 25.04.	0.000 0.000	N
3.2 % Worst-of American Barrier Quanto Autocallable Notes on a Basket of Indices S174013	CAD	1'000.00	21.07.2015	21.07.2017	12 791 528		-	100.000	100.000	21.07.	6.429	N
Certificate (Rep.31.7.17) on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	31.07.2013	24.07.2017	11 862 999		-	96.510	100.000		0.000	Y
5.51 % Reverse Convertible on Anheus.-Busch InBev	EUR	1'000.00	26.07.2016	26.07.2017	29 018 486		-	100.000	100.000	26.01. 26.07.	0.05382 0.0553	N
Principal Protected Note on Barclays Capital ERA ER-Index	CHF	1'000.00	08.08.2011	08.08.2017	11 862 371		-	99.000	108.000		0.000	Y
1 % Kick-In GOAL on Euro Stoxx 50-Index	CHF	1'000.00	14.08.2015	14.08.2017	22 906 279		-	100.000	100.000	16.02. 16.05. 14.08.	0.000 0.000 0.000	N
7 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.08.2016	17.08.2017	29 018 625		-	100.000	100.000	17.02. 17.08.	0.05041 0.04958	N
6.84 % Reverse Convertible on Richemont N	CHF	1'000.00	25.08.2016	25.08.2017	29 018 685		-	100.000	100.000	27.02. 25.08.	0.05095 0.04904	N
6.19 % Reverse Convertible on The Swatch Grp	CHF	5'000.00	25.08.2016	25.08.2017	29 018 684		-	100.000	100.000	27.02. 25.08.	0.25479 0.2452	N
7.74 % Notes on Shares-Basket	CHF	1'000.00	04.09.2015	04.09.2017	29 017 054		-	100.000	100.000	06.03. 04.09.	0.100 0.100	N
Protected Note on Nasdaq 100-Index	USD	1'000.00	13.03.2015	15.09.2017	26 829 210		-	97.064	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.9 % Notes on Shares-Basket	CHF	1'000.00	18.09.2015	18.09.2017	28 421 429		-	100.000	100.000	13.03. 18.09.	0.09917 0.10465	N
Notes on Euro Stoxx 50-Ind ex	CHF	1'000.00	26.09.2014	26.09.2017	12 790 677		-	99.840	100.000		0.000	Y
Principal Protected Note VRN on S&P GSCI Excess Return Index Reg-S	EUR	50'000.00	12.10.2009	12.10.2017	10 537 683		-	77.540	100.000		0.000	Y
PERLES Plus on Nikkei 225 Index	JPY	100'000.00	26.02.2014	26.10.2017	22 905 942		-	99.040	100.000		0.000	Y
Capital Protected Notes on SMI-Index	CHF	1'000.00	28.10.2014	28.10.2017	22 906 128		-	94.857	95.000		0.000	Y
Worst-of European Barrier Autocallable Notes VRN on a Basket of Shs S176898	EUR	1'000.00	29.10.2015	30.10.2017	12 789 612		-	99.920	100.000		0.000	Y
1.2 % Reverse Convertible on EURO STOXX 50	CHF	1'000.00	28.10.2016	30.10.2017	34 015 440		-	100.000	100.000	30.10.	0.100	Y
Protection Participation on Equities	EUR	1'000.00	02.02.2017	02.11.2017	26 829 415		-	96.000	96.000		0.000	Y
(no min.) Capital Protected Notes on basket of currencies	USD	1'000.00	07.11.2014	07.11.2017	25 273 787		-	96.650	100.000		0.000	Y
Express Certificate on EUR/NOK Exchange Rate	EUR	1'000.00	07.11.2014	07.11.2017	25 273 788		-	99.010	100.000		0.000	Y
1 % (pro rata) Kick-In GOAL auf Euro Stoxx 50-Index	EUR	1'000.00	17.11.2015	17.11.2017	22 906 306		-	100.000	100.000	17.02. 17.05. 17.08. 17.11.	0.1064 0.10912 0.11321 0.11675	N
3.05 % Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	CHF	1'000.00	18.11.2016	20.11.2017	34 015 608		-	100.000	100.000	20.11.	0.100	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	26.08.2016	27.11.2017	29 018 677		-	97.886	98.870		0.000	Y
5.5 % Kick-In GOAL on Euro Stoxx 50-Index	EUR	1'000.00	30.11.2015	30.11.2017	22 906 311		-	100.000	100.000	28.02. 28.05. 28.08. 30.11.	0.07449 0.07638 0.07992 0.08195	N
6.11 % Reverse Convertible on Continental	CHF	1'000.00	01.12.2016	01.12.2017	34 015 862		-	100.000	100.000	01.06. 01.12.	0.04986 0.05013	N
4 % Kick-In GOAL auf Euro Stoxx 50-Index	CHF	1'000.00	23.12.2015	27.12.2017	22 906 318		-	100.000	100.000	23.03. 23.06. 23.09. 27.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
7.46 % Reverse Convertible 2016-15.01.18 on Equities	EUR	1'000.00	05.01.2017	15.01.2018	35 118 386	%	99.760	100.000	100.000		0.000	N
8.72 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	10.01.2017	15.01.2018	35 118 403	%	99.800	100.000	100.000	10.07.	0.24794	N
6.03 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	11.01.2017	15.01.2018	35 118 425	%	99.720	100.000	100.000	11.07.	0.24794	N
9.72 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	11.01.2017	15.01.2018	35 118 417	%	99.830	100.000	100.000	11.07.	0.24794	N
9.74 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	11.01.2017	15.01.2018	35 118 416	%	99.830	100.000	100.000	11.07.	0.24794	N
5.23 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	12.01.2017	15.01.2018	35 118 445	%	99.690	100.000	100.000	12.07.	0.04958	N
5.84 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	12.01.2017	15.01.2018	35 118 435	%	99.710	100.000	100.000	12.07.	0.24794	N
5.91 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	13.01.2017	15.01.2018	35 118 464	%	99.710	100.000	100.000	13.07.	0.24794	N
7 % Reverse Convertible on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	13.01.2017	15.01.2018	35 118 471	%	99.740	100.000	100.000	13.07.	0.05472	N
8.16 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.07.2017	15.01.2018	36 828 531	%	99.780	100.000	100.000	13.10.	0.000	N
8.04 % Reverse Convertible on Deutsche Bank N	CHF	1'000.00	14.07.2017	15.01.2018	36 828 566	%	99.580	100.000	100.000	14.08. 14.09. 14.10. 14.11. 14.12.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
6.72 % Reverse Convertible on BHP Billiton Rg 14.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	14.07.2017	15.01.2018	36 828 567		-	100.000	100.000	14.08. 14.09.	0.000 0.000	N
6.6 % Reverse Convertible on Lvmh 14.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	14.07.2017	15.01.2018	36 828 572		-	100.000	100.000	14.08. 14.09.	0.000 0.000	N
7.98 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.07.2017	15.01.2018	36 828 582	%	99.780	100.000	100.000	16.10.	0.000	N
5.82 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.01.2017	16.01.2018	35 118 484	%	99.730	100.000	100.000	17.07.	0.04986	N
11.86 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	16.01.2017	16.01.2018	35 118 487	%	99.900	100.000	100.000	17.07.	4.894	N
9.84 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	16.01.2017	16.01.2018	35 118 483	%	99.860	100.000	100.000	17.07.	0.24931	N
5.78 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	16.01.2017	16.01.2018	35 118 482	%	99.730	100.000	100.000	17.07.	0.24931	N
5.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	16.01.2017	16.01.2018	35 118 488	%	99.720	100.000	100.000	17.07.	0.24931	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
6.12 % Reverse Convertible on Nokia Rg	CHF	1'000.00	16.06.2017	16.01.2018	36 828 018	%	67.110	100.000	100.000	17.07. 16.08. 18.09. 16.10. 16.11. 18.12.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
9 % Reverse Convertible on Symantec Rg	USD	1'000.00	16.06.2017	16.01.2018	36 828 111	%	99.130	100.000	100.000	18.12.	7.392	N
6.93 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.07.2017	16.01.2018	36 828 548	%	98.820	100.000	100.000	13.10.	3.585	N
10.63 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.01.2017	17.01.2018	35 118 506	%	99.920	100.000	100.000	17.07.	0.04958	N
3.09 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	17.01.2017	17.01.2018	35 118 493	%	99.650	100.000	100.000	17.07.	0.24794	N
8.66 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	18.01.2017	18.01.2018	35 118 527	%	99.870	100.000	100.000	18.07.	0.24794	N
4.39 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	10.01.2017	19.01.2018	35 118 400	%	99.730	100.000	100.000		0.000	N
10.42 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.01.2017	19.01.2018	35 118 523	%	79.180	100.000	100.000	19.07.	8.045	N
11 % Reverse Convertible on Petroleo Br Sp ADR	USD	1'000.00	19.01.2017	19.01.2018	35 118 532	%	100.880	100.000	100.000	19.07.	8.045	N
8.51 % Reverse Convertible on Nokia	EUR	1'000.00	20.01.2017	22.01.2018	35 118 561	%	99.870	100.000	100.000	20.07.	0.05488	N
10.74 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.01.2017	22.01.2018	35 118 554	%	99.390	100.000	100.000	20.07.	8.020	N
3.58 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.01.2017	22.01.2018	35 118 573	%	99.730	100.000	100.000	20.07.	0.04958	N
10.08 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	20.01.2017	22.01.2018	35 118 562	%	99.990	100.000	100.000	20.07.	4.716	N
10 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	20.01.2017	22.01.2018	35 118 560	%	99.990	100.000	100.000	20.07.	4.716	N
8.32 % Reverse Convertible on Equities 20.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	GBP	1'000.00	20.01.2017	22.01.2018	35 118 576		-	100.000	100.000	20.04.	0.000	N
7.62 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.04.2017	22.01.2018	36 016 625	%	99.930	100.000	100.000	20.10.	0.05013	N
5.72 % Reverse Convertible on Valeo	EUR	1'000.00	04.07.2017	22.01.2018	36 828 386	%	99.820	100.000	100.000		0.000	N
14.37 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.07.2017	22.01.2018	36 828 699	%	91.420	100.000	100.000	23.10.	3.706	N
7.41 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.01.2017	23.01.2018	35 118 436	%	99.930	100.000	100.000		0.000	N
11.45 % Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	23.01.2017	23.01.2018	35 118 580	%	99.750	100.000	100.000	24.07.	40.095	N
8.09 % Reverse Convertible on Telefonica Br	EUR	1'000.00	23.06.2017	23.01.2018	36 828 211	%	99.090	100.000	100.000	27.12.	0.000	N
5.3 % Reverse Convertible on Dufry N	CHF	1'000.00	23.06.2017	23.01.2018	36 828 219	%	99.700	100.000	100.000	27.12.	0.000	N
5 % Reverse Convertible on Rio Tinto	GBP	1'000.00	24.01.2017	24.01.2018	35 118 597	%	99.760	100.000	100.000	24.07.	4.712	N
5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.01.2017	24.01.2018	35 118 610	%	99.810	100.000	100.000	24.07.	0.05462	N
4.5 % Reverse Convertible on SKF -B-	SEK	10'000.00	24.01.2017	24.01.2018	35 118 609	%	99.790	100.000	100.000	24.07.	0.05703	N
12.16 % Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	24.01.2017	24.01.2018	35 118 618	%	99.570	100.000	100.000	24.07.	39.875	N
8.43 % Reverse Convertible on Mondelez Int-A	USD	1'000.00	24.01.2017	24.01.2018	35 118 615	%	99.380	100.000	100.000	24.07.	7.975	N
6.84 % Reverse Convertible on Axa 24.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	24.01.2017	24.01.2018	35 118 600		-	100.000	100.000		0.000	N
10.04 % Reverse Convertible on Equities 25.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	25.01.2017	25.01.2018	35 118 626		-	100.000	100.000	25.07. 25.10.	0.000 0.000	N
10.53 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.01.2017	25.01.2018	35 118 637	%	99.440	100.000	100.000	25.07.	7.998	N
10.42 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.04.2017	25.01.2018	36 016 676	%	99.920	100.000	100.000	25.10.	0.05862	N
4.16 % Reverse Convertible on BP Rg	GBP	1'000.00	25.07.2017	25.01.2018	36 828 739	%	99.720	100.000	100.000	25.10.	1.454	N
7.87 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	10.01.2017	26.01.2018	35 118 391	%	100.040	100.000	100.000		0.000	N
8.05 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.01.2017	26.01.2018	35 118 667	%	99.930	100.000	100.000	26.07.	0.0553	N
6.51 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.01.2017	26.01.2018	35 118 659	%	99.840	100.000	100.000	26.07.	0.0553	N
7.3 % Reverse Convertible on Alphabet-A	USD	5'000.00	26.01.2017	26.01.2018	35 118 671	%	99.350	100.000	100.000	26.07.	40.656	N
9.72 % Reverse Convertible on Facebook-A	USD	1'000.00	26.01.2017	26.01.2018	35 118 672	%	99.750	100.000	100.000	26.07.	8.131	N
6.08 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.01.2017	26.01.2018	35 118 660	%	99.910	100.000	100.000	26.07.	0.0553	N
6.9 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	26.01.2017	26.01.2018	35 118 676	%	99.970	100.000	100.000	26.07.	0.04958	N
9.41 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.01.2017	26.01.2018	35 118 669	%	99.450	100.000	100.000	26.07.	8.131	N
13.45 % Reverse Convertible on Equities	NOK	10'000.00	26.01.2017	26.01.2018	35 118 664	%	100.290	100.000	100.000	26.07.	9.346	N
10.29 % Reverse Convertible on Nokia Rg	EUR	1'000.00	26.01.2017	26.01.2018	35 118 657	%	99.920	100.000	100.000	26.07.	0.0553	N
5.79 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	26.01.2017	26.01.2018	35 118 661	%	99.920	100.000	100.000	26.07.	0.24794	N
5.1 % Reverse Convertible on FTSE 100	GBP	1'000.00	27.01.2017	29.01.2018	35 118 689	%	99.830	100.000	100.000	27.07.	4.812	N
6 % Reverse Convertible on Nokia Rg	CHF	1'000.00	29.06.2017	29.01.2018	36 828 238	%	67.610	100.000	100.000	31.07. 29.08. 29.09. 30.10. 29.11. 29.12.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
8.52 % Reverse Convertible on Alibaba Grp Sp ADS 31.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	29.06.2017	29.01.2018	36 828 331		-	100.000	100.000	31.07.	1.244	N
6 % Reverse Convertible on Lvmh	CHF	1'000.00	28.07.2017	29.01.2018	37 559 647	%	99.970	100.000	100.000	30.10.	0.000	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	30.01.2017	30.01.2018	35 118 703	%	99.990	100.000	100.000	31.07.	0.24931	N
6.41 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	30.01.2017	30.01.2018	35 118 710	%	100.010	100.000	100.000	31.07.	0.24931	N
12.35 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.06.2017	30.01.2018	36 828 351	%	100.390	100.000	100.000		0.000	N
16.12 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.01.2017	31.01.2018	35 118 732	%	100.250	100.000	100.000	02.05. 31.07. 30.10.	40.054 38.884 40.178	N
4.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	31.01.2017	31.01.2018	35 118 733	%	99.920	100.000	100.000	31.07.	0.24794	N
3.77 % Reverse Convertible on Pernod Ricard	EUR	1'000.00	31.01.2017	31.01.2018	35 118 718	%	99.830	100.000	100.000	31.07.	0.05641	N
5.01 % Reverse Convertible on Swiss Re N	CHF	1'000.00	31.01.2017	31.01.2018	35 118 731	%	99.940	100.000	100.000	31.07.	0.04958	N
2.3 % Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	CHF	1'000.00	31.01.2017	31.01.2018	35 118 636	%	101.870	100.000	100.000		0.000	Y
4.63 % Reverse Convertible on Logitech Intl N	CHF	1'000.00	31.01.2017	31.01.2018	35 118 720	%	99.910	100.000	100.000	31.07.	0.04958	N
7.93 % Reverse Convertible on Logitech Intl N	CHF	1'000.00	31.01.2017	31.01.2018	35 118 734	%	100.160	100.000	100.000	31.07.	0.04958	N
5.58 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	01.02.2017	01.02.2018	35 118 741	%	100.010	100.000	100.000	02.08.	0.24931	N
8.08 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	01.02.2017	01.02.2018	35 118 748	%	100.090	100.000	100.000	02.08.	0.04986	N
8.18 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	02.02.2017	02.02.2018	35 118 763	%	100.210	100.000	100.000	02.08.	0.04958	N
7.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.05.2017	02.02.2018	36 016 740	%	99.020	100.000	100.000	02.11.	0.05041	N
11.57 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.05.2017	02.02.2018	36 016 741	%	100.340	100.000	100.000	02.11.	0.05041	N
8.08 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.11.2016	05.02.2018	34 015 521	%	99.400	100.000	100.000	06.02. 04.05. 04.08. 06.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
11.15 % Reverse Convertible 2016-05.02.18 on Equities	USD	1'000.00	03.01.2017	05.02.2018	34 015 697	%	99.820	100.000	100.000		0.000	N
5.16 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	03.02.2017	05.02.2018	35 118 771	%	100.040	100.000	100.000	03.08.	0.24794	N
7.22 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	03.02.2017	05.02.2018	35 118 770	%	100.190	100.000	100.000	03.08.	0.04958	N
7.78 % Reverse Convertible on UBS Group N	CHF	1'000.00	03.02.2017	05.02.2018	35 118 769	%	100.260	100.000	100.000	03.08.	0.04958	N
5.77 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	03.02.2017	05.02.2018	35 118 774	%	100.100	100.000	100.000	03.08.	0.49588	N
9.35 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	04.05.2017	05.02.2018	36 016 758	%	100.340	100.000	100.000	06.11.	0.25479	N
6.96 % Reverse Convertible on Commerzbank I 3.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	03.07.2017	05.02.2018	36 828 373		-	100.000	100.000	03.08.	0.000	N
10.32 % Reverse Convertible on Fiat Chrysler Au Rg 3.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	03.07.2017	05.02.2018	36 828 374		-	100.000	100.000	03.08.	0.000	N
7.6 % Reverse Convertible on Equities	EUR	5'000.00	05.07.2017	05.02.2018	36 828 413	%	100.210	100.000	100.000		0.000	N
6.48 % Reverse Convertible on Nokia Rg	EUR	1'000.00	05.07.2017	05.02.2018	36 828 314	%	68.050	100.000	100.000	07.08. 05.09. 05.10. 06.11. 05.12.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
10.2 % Reverse Convertible on Fiat Chrysler Au Rg 3.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	03.08.2017	05.02.2018	37 559 677		-	100.000	100.000	04.09. 03.10.	0.000 0.000	N
6.84 % Reverse Convertible on Renault 3.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	03.08.2017	05.02.2018	37 559 674		-	100.000	100.000	04.09. 03.10.	0.000 0.000	N
7.56 % Reverse Convertible on Rio Tinto Rg 3.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	03.08.2017	05.02.2018	37 559 666		-	100.000	100.000	05.09. 03.10.	1.156 1.177	N
6.12 % Reverse Convertible on eBay Rg 3.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	03.08.2017	05.02.2018	37 559 686		-	100.000	100.000	05.09. 03.10. 03.11.	1.156 1.177 1.209	N
7.2 % Reverse Convertible on Mondelez Intl Rg-A	USD	1'000.00	03.08.2017	05.02.2018	37 559 687	%	98.900	100.000	100.000	05.09. 03.10. 03.11. 04.12.	1.156 1.177 1.209 1.190	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
7.56 % Reverse Convertible on Rio Tinto Rg 3.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	03.08.2017	05.02.2018	37 559 679		-	100.000	100.000	05.09. 03.10.	1.156 1.177	N
7.32 % Reverse Convertible on Glencore Rg 3.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	03.08.2017	05.02.2018	37 559 680		-	100.000	100.000	05.09. 03.10.	1.156 1.177	N
6.84 % Reverse Convertible on Telefonica Br	EUR	1'000.00	04.08.2017	05.02.2018	37 559 691	%	98.310	100.000	100.000	04.09. 04.10. 06.11. 04.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
7.32 % Reverse Convertible on Renault 4.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	04.08.2017	05.02.2018	37 559 665		-	100.000	100.000	04.09. 04.10.	0.000 0.000	N
7.2 % Reverse Convertible on Renault 4.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	04.08.2017	05.02.2018	37 559 662		-	100.000	100.000	04.09. 04.10.	0.000 0.000	N
8.7 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.02.2017	06.02.2018	35 118 798	%	100.270	100.000	100.000	07.08.	0.05719	N
8.83 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.02.2017	06.02.2018	35 118 806	%	99.620	100.000	100.000	07.08.	8.339	N
5.89 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	06.02.2017	06.02.2018	35 118 810	%	100.120	100.000	100.000	07.08.	0.24931	N
10.51 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.02.2017	06.02.2018	35 118 803	%	100.360	100.000	100.000	07.08.	0.04986	N
8.81 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.02.2017	06.02.2018	35 118 800	%	100.270	100.000	100.000	07.08.	0.05719	N
8.64 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.02.2017	06.02.2018	35 118 794	%	100.370	100.000	100.000	07.08.	0.04986	N
6.16 % Reverse Convertible on Zurich Insur Grp N 7.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	07.02.2017	07.02.2018	35 118 813		-	100.000	100.000	07.08.	0.000	N
7.39 % Reverse Convertible on Engie	EUR	1'000.00	07.02.2017	07.02.2018	35 118 814	%	100.250	100.000	100.000	07.08.	0.05687	N
6 % Reverse Convertible on AXA	CHF	1'000.00	07.06.2017	07.02.2018	36 827 895	%	100.000	100.000	100.000	07.12.	0.000	N
7.17 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.02.2017	08.02.2018	35 118 837	%	100.200	100.000	100.000	08.08.	0.05681	N
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	08.02.2017	08.02.2018	35 118 840	%	99.960	100.000	100.000	08.08.	0.49589	N
6.72 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.02.2017	08.02.2018	35 118 742	%	100.210	100.000	100.000	08.08.	0.05681	N
6.31 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	08.02.2017	08.02.2018	35 118 839	%	100.200	100.000	100.000	08.08.	0.49588	N
5.54 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.02.2017	08.02.2018	35 118 740	%	100.090	100.000	100.000	08.08.	0.05681	N
10.02 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	30.01.2017	09.02.2018	35 118 700	%	100.460	100.000	100.000		0.000	N
9.64 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.02.2017	09.02.2018	35 118 862	%	99.400	100.000	100.000	09.05. 09.08. 09.11.	24.229 23.277 24.057	N
9.39 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.02.2017	09.02.2018	35 118 879	%	99.730	100.000	100.000	09.08.	8.238	N
6.84 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	09.02.2017	09.02.2018	35 118 856	%	100.250	100.000	100.000	09.08.	0.24794	N
8.02 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	09.05.2017	09.02.2018	36 016 819	%	100.350	100.000	100.000	09.11.	0.05041	N
3.02 % Reverse Convertible on Equities	CHF	20'000.00	06.07.2017	09.02.2018	36 828 432	%	99.890	100.000	100.000		0.000	N
8.07 % Reverse Convertible on UBS Group N	CHF	1'000.00	10.02.2017	12.02.2018	35 118 895	%	100.380	100.000	100.000	10.08.	0.04958	N
7.73 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.02.2017	12.02.2018	35 118 891	%	100.280	100.000	100.000	10.08.	0.04958	N
8.28 % Reverse Convertible on Deutsche Bank N 11.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	10.07.2017	12.02.2018	36 828 480		-	100.000	100.000	10.08. 11.09. 10.10. 10.11. 10.12.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
8.61 % Reverse Convertible on Dufry N	CHF	1'000.00	11.07.2017	12.02.2018	36 828 496	%	99.500	100.000	100.000		0.000	N
8.69 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.08.2017	12.02.2018	37 559 774	%	100.210	100.000	100.000	10.11.	0.000	N
7.58 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.02.2017	13.02.2018	35 118 825	%	100.290	100.000	100.000	10.08.	0.04958	N
9.46 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.02.2017	13.02.2018	35 118 824	%	100.400	100.000	100.000	10.08.	0.04958	N
8.17 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.02.2017	13.02.2018	35 118 901	%	100.520	100.000	100.000	14.08.	0.04986	N
8.27 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.02.2017	13.02.2018	35 118 902	%	100.500	100.000	100.000	14.08.	0.04986	N
6.97 % Reverse Convertible on Citigroup Rg	USD	1'000.00	14.02.2017	14.02.2018	35 118 928	%	99.590	100.000	100.000	14.08.	8.226	N
5.82 % Reverse Convertible on Invesco Rg	USD	1'000.00	14.02.2017	14.02.2018	35 118 930	%	99.460	100.000	100.000	14.08.	8.226	N
7.45 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.02.2017	14.02.2018	35 118 926	%	100.300	100.000	100.000	14.08.	0.04958	N
6.01 % Reverse Convertible on Goldman Sachs Gr Rg	USD	1'000.00	14.02.2017	14.02.2018	35 118 929	%	99.390	100.000	100.000	14.08.	8.226	N
7.78 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.02.2017	14.02.2018	35 118 931	%	100.340	100.000	100.000	14.08.	0.04958	N
10.29 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.02.2017	15.02.2018	35 118 949	%	99.820	100.000	100.000	15.08.	8.249	N
9.72 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.02.2017	15.02.2018	35 118 954	%	100.440	100.000	100.000	15.08.	0.04958	N
8.87 % Reverse Convertible on Illumina Rg	USD	1'000.00	15.02.2017	15.02.2018	35 118 945	%	99.830	100.000	100.000	15.08.	8.249	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF	/%	Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
9.4 % Reverse Convertible on Volkswagen Vz I 16.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	16.02.2017	16.02.2018	35 118 971		-	100.000	100.000	16.05.	25.712	N
9.49 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.02.2017	19.02.2018	35 118 984	%	100.590	100.000	100.000	17.08.	0.05614	N
7.24 % Reverse Convertible on Zurich Insur Gr N 17.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	17.02.2017	19.02.2018	35 118 985		-	100.000	100.000	17.05.	0.000	N
6.05 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	17.02.2017	19.02.2018	35 118 977	%	100.270	100.000	100.000	17.08.	0.49589	N
6.17 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.02.2017	19.02.2018	35 118 975	%	100.350	100.000	100.000	17.08.	0.04958	N
5.94 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	17.02.2017	19.02.2018	35 118 976	%	100.350	100.000	100.000	17.08.	0.24794	N
6.23 % Reverse Convertible on Rio Tinto Rg	GBP	1'000.00	17.08.2017	19.02.2018	37 559 843	%	100.230	100.000	100.000	17.11.	1.351	N
7.99 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	20.07.2017	20.02.2018	36 828 670	%	99.790	100.000	100.000		0.000	N
6.76 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.02.2017	21.02.2018	35 119 008	%	99.540	100.000	100.000	22.05. 21.08. 21.11.	0.000 0.000 0.000	N
5.72 % Reverse Convertible on Equities 22.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	21.02.2017	21.02.2018	35 119 020		-	100.000	100.000	 22.05.	 0.000	N
9.36 % Reverse Convertible on CS Group N	CHF	1'000.00	22.02.2017	22.02.2018	35 119 025	%	100.750	100.000	100.000	22.08.	0.04958	N
11.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	22.02.2017	22.02.2018	35 119 032	%	101.080	100.000	100.000	22.08.	0.24794	N
8.42 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	22.02.2017	22.02.2018	35 119 026	%	100.540	100.000	100.000	22.08.	4.620	N
5.87 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	01.06.2017	22.02.2018	36 827 836	%	100.210	100.000	100.000	01.12.	0.000	N
9.37 % Reverse Convertible on CS Group N	CHF	1'000.00	23.02.2017	23.02.2018	35 119 052	%	100.770	100.000	100.000	23.08.	0.04958	N
7.36 % Reverse Convertible on Amazon.Com Rg	USD	5'000.00	23.02.2017	23.02.2018	35 119 033	%	99.750	100.000	100.000	23.08.	40.911	N
5.56 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.02.2017	23.02.2018	35 119 056	%	100.350	100.000	100.000	23.05. 23.08. 23.11.	0.000 0.000 0.000	N
10.2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.02.2017	23.02.2018	35 119 058	%	100.930	100.000	100.000	23.05. 23.08. 23.11.	0.000 0.000 0.000	N
7.04 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.02.2017	26.02.2018	35 119 076	%	99.420	100.000	100.000	24.08.	0.05646	N
6.44 % Reverse Convertible on Apple Rg 24.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	24.02.2017	26.02.2018	35 119 059		-	100.000	100.000	24.05.	15.724	N
5 % Reverse Convertible on Equities 24.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	24.02.2017	26.02.2018	35 119 066		-	100.000	100.000	24.05.	0.125	N
6.64 % Reverse Convertible on Clariant N	CHF	1'000.00	24.02.2017	26.02.2018	35 119 077	%	100.610	100.000	100.000	24.08.	0.04958	N
7.65 % Reverse Convertible on Dufry N	CHF	1'000.00	25.07.2017	26.02.2018	36 828 738	%	89.190	100.000	100.000		0.000	N
7.8 % Reverse Convertible on AstraZeneca Rg 25.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	25.07.2017	26.02.2018	36 828 736		-	100.000	100.000	25.08. 25.09. 25.10.	0.000 0.000 0.000	N
8.04 % Reverse Convertible on AstraZeneca Rg 25.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	25.07.2017	26.02.2018	36 828 737		-	100.000	100.000	25.08. 25.09. 25.10.	0.000 0.000 0.000	N
11.29 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	26.07.2017	26.02.2018	37 559 606	%	100.150	100.000	100.000		0.000	N
10.44 % Reverse Convertible on Fiat Chrysler Au Rg 24.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	24.08.2017	26.02.2018	37 559 868		-	100.000	100.000	25.09. 24.10.	0.000 0.000	N
5.29 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	25.08.2017	26.02.2018	37 559 942	%	100.220	100.000	100.000	27.11.	0.000	N
7.2 % Reverse Convertible on Glencore Rg 25.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	25.08.2017	26.02.2018	37 559 937		-	100.000	100.000	25.09. 25.10.	0.000 0.000	N
7.08 % Reverse Convertible on Nokia Rg	EUR	1'000.00	25.08.2017	26.02.2018	37 559 938	%	73.730	100.000	100.000	25.09. 25.10. 27.11. 27.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
4.96 % Reverse Convertible on Vodafone Group Rg	GBP	1'000.00	27.07.2017	27.02.2018	37 559 641	%	100.050	100.000	100.000		0.000	N
7.92 % Reverse Convertible on Bristol Myers Squib	USD	1'000.00	30.05.2017	28.02.2018	36 827 792	%	99.630	100.000	100.000	30.11.	7.771	N
10.03 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	31.07.2017	28.02.2018	37 559 660	%	99.230	100.000	100.000		0.000	N
12.26 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.08.2017	28.02.2018	37 559 918	%	100.090	100.000	100.000	24.11.	0.000	N
9.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.02.2017	01.03.2018	35 119 035	%	100.520	100.000	100.000	23.08.	0.04958	N
6.36 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	01.03.2017	01.03.2018	35 119 111	%	100.520	100.000	100.000	01.09.	0.05041	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
8.08 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	01.03.2017	01.03.2018	35 119 114	%	99.730	100.000	100.000	01.09.	0.05764	N
3.56 % Reverse Convertible on Zurich Insur Gr N	CHF	5'000.00	01.03.2017	01.03.2018	35 119 096		-	100.000	100.000	01.06. 01.09. 01.12.	0.000 0.000 0.000	N
1.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
4.82 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	01.03.2017	01.03.2018	35 119 110	%	100.270	100.000	100.000	01.09.	0.25205	N
8.46 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.06.2017	01.03.2018	36 827 844	%	98.760	100.000	100.000	01.12.	7.746	N
6.24 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.03.2017	02.03.2018	35 119 125		-	100.000	100.000	02.06.	15.600	N
2.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
5.96 % Reverse Convertible on CS Group N	CHF	1'000.00	02.03.2017	02.03.2018	35 119 124	%	100.480	100.000	100.000	04.09.	0.05095	N
12.18 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.08.2017	02.03.2018	37 559 689	%	94.400	100.000	100.000		0.000	N
9.59 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	02.08.2017	02.03.2018	37 559 706	%	99.530	100.000	100.000		0.000	N
9.92 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	02.08.2017	02.03.2018	37 559 699	%	99.550	100.000	100.000		0.000	N
7.2 % Reverse Convertible on Koninklijke KPN Br	EUR	1'000.00	03.03.2017	05.03.2018	35 119 144	%	100.740	100.000	100.000	04.09.	0.05772	N
7.12 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.03.2017	05.03.2018	35 119 153		-	100.000	100.000	06.06.	0.000	N
6.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
9.19 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.03.2017	05.03.2018	35 119 147	%	100.500	100.000	100.000	05.09.	0.05095	N
6.63 % Reverse Convertible on ESTXBnk EUR P	EUR	1'000.00	03.03.2017	05.03.2018	35 119 154	%	100.690	100.000	100.000	04.09.	0.05772	N
7.11 % Reverse Convertible on Royal Dutch Shell-A	GBP	1'000.00	03.05.2017	05.03.2018	36 016 750	%	100.620	100.000	100.000	03.11.	4.085	N
10 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	06.03.2017	06.03.2018	35 119 158	%	101.210	100.000	100.000	06.09.	0.25205	N
8.43 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.03.2017	06.03.2018	35 119 163	%	97.540	100.000	100.000	06.09.	8.365	N
9.84 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.03.2017	06.03.2018	35 119 161		-	100.000	100.000	06.04. 08.05. 06.06. 06.07. 07.08.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
7.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
5.04 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.03.2017	07.03.2018	35 119 172	%	99.670	100.000	100.000	07.06. 07.09. 07.12.	0.000 0.000 0.000	N
7.36 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	08.06.2017	08.03.2018	36 827 932	%	100.290	100.000	100.000	08.12.	0.000	N
16.64 % Reverse Convertible on Vallourec	EUR	1'000.00	08.06.2017	08.03.2018	36 827 968	%	95.960	100.000	100.000	08.09. 08.12.	0.000 0.000	N
8.48 % Reverse Convertible on EDF	EUR	1'000.00	08.06.2017	08.03.2018	36 827 967		-	100.000	100.000	08.09. 08.12.	0.000 0.000	N
8.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
9.04 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	28.02.2017	09.03.2018	35 119 103	%	100.450	100.000	100.000		0.000	N
7.33 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	09.03.2017	09.03.2018	35 119 213	%	98.400	100.000	100.000	11.09.	0.05095	N
8.52 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	09.06.2017	09.03.2018	36 828 008	%	100.930	100.000	100.000	11.12.	0.000	N
8.51 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.03.2017	12.03.2018	35 119 259	%	53.590	100.000	100.000	11.09.	8.685	N
7.88 % Reverse Convertible on BMW I	EUR	1'000.00	10.03.2017	12.03.2018	35 119 266	%	100.670	100.000	100.000	12.06. 11.09. 11.12.	0.000 0.000 0.000	N
6.6 % Reverse Convertible on AstraZeneca Rg	CHF	1'000.00	11.07.2017	12.03.2018	36 828 495		-	100.000	100.000	11.08. 11.09. 11.10.	0.000 0.000 0.000	N
13.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
0.78 % Notes on Euro Stoxx 50-Index	CHF	1'000.00	20.03.2015	13.03.2018	12 791 005	%	100.480	100.000	100.000	15.03. 15.06. 15.09.	0.000 0.000 0.000	N
8.16 % Reverse Convertible on Volkswagen Vz I	EUR	1'000.00	13.03.2017	13.03.2018	35 119 264		-	100.000	100.000	13.06. 13.09. 13.12.	0.000 0.000 0.000	N
13.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
5 % Reverse Convertible on Swisscom N	CHF	5'000.00	15.03.2017	15.03.2018	35 119 322	%	100.640	100.000	100.000	15.09.	0.25205	N
9.33 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.03.2017	15.03.2018	35 119 320	%	101.030	100.000	100.000	15.09.	0.05041	N
8.61 % Reverse Convertible on Schlumberger Rg	USD	1'000.00	15.03.2017	15.03.2018	35 119 339	%	85.010	100.000	100.000	15.09.	8.713	N
8.51 % Reverse Convertible on Nike -B-	USD	1'000.00	15.03.2017	15.03.2018	35 119 338	%	100.080	100.000	100.000	15.09.	8.713	N
5.66 % Reverse Convertible on Swisscom N	CHF	5'000.00	15.03.2017	15.03.2018	35 119 336	%	100.740	100.000	100.000	15.09.	0.25205	N
5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.03.2017	15.03.2018	35 119 324	%	98.860	100.000	100.000	15.09.	0.05791	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5 % Reverse Convertible on Swiss Re N	CHF	1'000.00	15.03.2017	15.03.2018	35 119 321	%	100.310	100.000	100.000	15.09.	0.05041	N
7.06 % Reverse Convertible on Allergan Rg	USD	1'000.00	17.03.2017	19.03.2018	36 016 131	%	67.870	100.000	100.000	18.09.	8.809	N
7 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.09.2017	19.03.2018	37 560 042	%	82.090	100.000	100.000		0.000	N
13.49 % Reverse Convertible on Banco Santander Rg	EUR	1'000.00	18.09.2017	19.03.2018	37 560 206	%	98.730	100.000	100.000	18.12.	0.000	N
6.72 % Reverse Convertible on Peugeot 20.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.09.2017	19.03.2018	37 560 141		-	100.000	100.000	18.10. 20.11.	0.000 0.000	N
7.2 % Reverse Convertible on Airbus Br 20.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.09.2017	19.03.2018	37 560 140		-	100.000	100.000	18.10. 20.11.	0.000 0.000	N
4.64 % Reverse Convertible on Statoil Rg 18.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	NOK	10'000.00	18.09.2017	19.03.2018	37 560 209		-	100.000	100.000	18.12.	13.707	N
6.04 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.03.2017	20.03.2018	36 016 135	%	100.840	100.000	100.000	20.06. 20.09. 20.12.	0.000 0.000 0.000	N
4.15 % Reverse Convertible on AstraZeneca Rg	GBP	1'000.00	20.03.2017	20.03.2018	36 016 134	%	100.210	100.000	100.000	20.09.	4.735	N
7.04 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.03.2017	20.03.2018	36 016 141	%	100.400	100.000	100.000	20.06. 20.09. 20.12.	0.000 0.000 0.000	N
12.8 % Reverse Convertible on Freeport McMoRan Rg 20.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	20.03.2017	20.03.2018	36 016 138		-	100.000	100.000	20.06. 20.09.	0.000 0.000	N
7.48 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.03.2017	20.03.2018	36 016 136	%	100.780	100.000	100.000	20.06. 20.09. 20.12.	0.000 0.000 0.000	N
8.52 % Reverse Convertible on Equities 20.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	5'000.00	20.06.2017	20.03.2018	36 828 159		-	100.000	100.000	20.09.	0.000	N
10.48 % Reverse Convertible on Equities 20.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	5'000.00	20.06.2017	20.03.2018	36 828 160		-	100.000	100.000	20.09.	17.432	N
5.55 % Reverse Convertible on BT Group Rg	EUR	1'000.00	21.03.2017	21.03.2018	36 016 157	%	96.470	100.000	100.000	21.09.	0.05848	N
7.92 % Reverse Convertible on Rio Tinto Rg 23.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	GBP	1'000.00	21.08.2017	21.03.2018	37 559 867		-	100.000	100.000	21.09. 23.10. 21.11. 21.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
9.43 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.03.2017	22.03.2018	36 016 190	%	100.720	100.000	100.000	22.09.	0.05041	N
4.15 % Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	22.03.2017	22.03.2018	36 016 182	%	100.350	100.000	100.000	22.09.	0.05845	N
7.19 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.03.2017	22.03.2018	36 016 200	%	100.730	100.000	100.000	22.09.	0.05041	N
5.27 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	22.03.2017	22.03.2018	36 016 181	%	100.470	100.000	100.000	22.09.	0.25205	N
13.4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.03.2017	22.03.2018	36 016 226	%	91.330	100.000	100.000	22.06. 22.09. 22.12.	0.000 0.000 0.000	N
8.92 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.03.2017	22.03.2018	36 016 196	%	100.770	100.000	100.000	22.06. 22.09. 22.12.	0.000 0.000 0.000	N
8.91 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.03.2017	22.03.2018	36 016 365	%	99.770	100.000	100.000	02.10.	8.881	N
8.15 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.06.2017	22.03.2018	36 827 951	%	100.300	100.000	100.000	07.12.	0.000	N
9.27 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.06.2017	22.03.2018	36 828 190	%	100.070	100.000	100.000	22.12.	7.840	N
8.52 % Reverse Convertible on Rio Tinto Rg 23.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	22.08.2017	22.03.2018	37 559 883		-	100.000	100.000	22.09. 23.10.	0.000 0.000	N
9.26 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.03.2017	23.03.2018	36 016 164	%	100.730	100.000	100.000	25.09.	0.05068	N
9.27 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.03.2017	26.03.2018	36 016 169	%	100.740	100.000	100.000	25.09.	0.05068	N
5.4 % Reverse Convertible on AB InBev Rg	EUR	1'000.00	24.03.2017	26.03.2018	36 016 246	%	97.440	100.000	100.000	25.09.	0.05829	N
9.12 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.03.2017	26.03.2018	36 016 251	%	101.500	100.000	100.000	25.09.	0.05068	N
7.5 % Reverse Convertible on Salesforce.com Rg	USD	1'000.00	27.03.2017	26.03.2018	36 016 254	%	99.960	100.000	100.000	27.09.	8.893	N
2.4 % Reverse Convertible on Royal Dutch Shell-A 27.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	27.03.2017	27.03.2018	36 016 265		-	100.000	100.000	27.06. 27.09.	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	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
11.08 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.03.2017	27.03.2018	36 016 257	%	97.070	100.000	100.000	27.06. 27.09. 27.12.	0.000 0.000 0.000	N
11.08 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.03.2017	27.03.2018	36 016 256	%	96.900	100.000	100.000	27.06. 27.09. 27.12.	0.000 0.000 0.000	N
5.43 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.06.2017	27.03.2018	36 828 276	%	99.150	100.000	100.000	27.12.	0.000	N
15.58 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	27.06.2017	27.03.2018	36 828 275	%	102.830	100.000	100.000	27.12.	3.585	N
15.04 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	27.06.2017	27.03.2018	36 828 268	%	102.690	100.000	100.000	27.12.	3.585	N
15.35 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	27.06.2017	27.03.2018	36 828 271	%	102.780	100.000	100.000	27.12.	3.585	N
10 % Reverse Convertible on Equities 28.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	28.03.2017	28.03.2018	36 016 282		-	100.000	100.000	28.06. 28.09.	0.000 0.000	N
9.61 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.06.2017	28.03.2018	36 828 349	%	100.780	100.000	100.000		0.000	N
0.85 % Notes on Euro Stoxx 50-Index	CHF	1'000.00	01.04.2015	03.04.2018	12 791 039	%	100.380	100.000	100.000	01.01. 01.04. 01.07. 01.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
10.04 % Reverse Convertible 2016-03.04.18 on Equities	EUR	1'000.00	03.01.2017	03.04.2018	35 118 379	%	92.870	100.000	100.000	03.07. 03.10.	0.000 0.000	N
12.54 % Reverse Convertible on Equities	NOK	10'000.00	29.03.2017	03.04.2018	36 016 302	%	102.280	100.000	100.000	29.09.	8.394	N
9.1 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.03.2017	03.04.2018	36 016 348	%	98.890	100.000	100.000	02.10.	0.05095	N
8.66 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	31.03.2017	03.04.2018	36 016 358	%	101.170	100.000	100.000	02.10.	4.846	N
7.92 % Reverse Convertible on Equities 5.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	05.05.2017	05.04.2018	36 016 788		-	100.000	100.000	06.06. 05.07. 07.08. 05.09. 05.10.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
10.25 % Reverse Convertible on Equities	CHF	20'000.00	21.07.2017	06.04.2018	36 828 690	%	101.840	100.000	100.000		0.000	N
9.97 % Reverse Convertible on Equities	CHF	20'000.00	24.07.2017	06.04.2018	36 828 710	%	101.740	100.000	100.000		0.000	N
6 % Reverse Convertible on Equities 9.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	07.07.2017	09.04.2018	36 828 460		-	100.000	100.000	09.10.	17.247	N
8.52 % Reverse Convertible on Anglo American Rg 8.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.09.2017	09.04.2018	37 560 087		-	100.000	100.000	09.10. 08.11.	0.000 0.000	N
5.12 % Reverse Convertible on Equities 10.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	10.04.2017	10.04.2018	36 016 466		-	100.000	100.000		0.000	N
9.09 % Reverse Convertible on BHP Billiton Rg	GBP	1'000.00	10.04.2017	10.04.2018	36 016 481	%	101.680	100.000	100.000	10.10.	4.648	N
5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.07.2017	10.04.2018	36 828 475	%	98.860	100.000	100.000		0.000	N
7.33 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	10.07.2017	10.04.2018	36 828 483	%	101.120	100.000	100.000		0.000	N
5.25 % Reverse Convertible on T-Mobile US Rg	USD	1'000.00	12.04.2017	12.04.2018	36 016 528	%	99.310	100.000	100.000	12.10.	8.760	N
7.78 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	09.05.2017	12.04.2018	36 016 820	%	100.400	100.000	100.000	09.11.	0.25205	N
8.73 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	10.05.2017	12.04.2018	36 016 838	%	100.630	100.000	100.000	10.11.	0.25205	N
7.79 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	15.05.2017	12.04.2018	36 016 918	%	100.650	100.000	100.000	15.11.	0.000	N
5.52 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	13.04.2017	13.04.2018	36 016 542	%	100.960	100.000	100.000	13.10.	0.25068	N
6.48 % Reverse Convertible on Equities 13.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	13.04.2017	13.04.2018	36 016 550		-	100.000	100.000	13.07.	0.000	N
7.84 % Reverse Convertible on Infineon Technolo N 13.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	13.04.2017	13.04.2018	36 016 541		-	100.000	100.000	13.07. 13.10.	0.000 0.000	N
6.12 % Reverse Convertible on UBS Group N	CHF	1'000.00	15.06.2017	16.04.2018	36 828 078	%	101.130	100.000	100.000	15.12.	0.000	N
Twin Win-Notes on OMX Stockholm 30-Index	SEK	10'000.00	16.04.2014	17.04.2018	22 905 991	%	113.530	93.840	100.000		0.000	Y
Perles Plus on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	17.04.2014	17.04.2018	22 906 001	CHF	1168.480	98.940	100.000		0.000	Y
8.33 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	21.04.2017	17.04.2018	36 016 628	%	101.020	100.000	100.000	23.10.	0.05068	N
15.22 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.08.2017	17.04.2018	37 559 847	%	86.760	100.000	100.000		0.000	N
10.01 % Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	18.04.2017	18.04.2018	36 016 598	%	100.600	100.000	100.000		0.000	N
5.57 % Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	18.04.2017	18.04.2018	36 016 562	%	100.320	100.000	100.000	18.10.	4.537	N
10.01 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.04.2017	19.04.2018	36 016 597	%	101.300	100.000	100.000	19.10.	0.0579	N
6.6 % Reverse Convertible on ING Group Rg	CHF	1'000.00	20.04.2017	19.04.2018	36 016 621	%	101.260	100.000	100.000	20.10.	0.05013	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.16 % Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	20.10.2016	20.04.2018	34 015 328		-	100.000	100.000	20.01. 20.04.	2.513 2.487	N
20.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
11.84 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	16.03.2017	20.04.2018	35 119 341	%	102.710	100.000	100.000		0.000	N
7.3 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.04.2017	20.04.2018	36 016 606	%	100.440	100.000	100.000	20.10.	0.05812	N
6.64 % Reverse Convertible on Micron Technolog Rg	CHF	1'000.00	20.04.2017	20.04.2018	36 016 624	%	101.060	100.000	100.000	20.10.	0.05013	N
7.56 % Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	20.04.2017	20.04.2018	36 016 652		-	100.000	100.000			N
20.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung										20.07.	0.000	
6 % Reverse Convertible on Societe Generale	EUR	1'000.00	20.04.2017	20.04.2018	36 016 614		-	100.000	100.000			N
20.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung										20.07.	0.000	
7.08 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.04.2017	20.04.2018	36 016 648	%	56.360	100.000	100.000	20.10.	8.826	N
4.76 % Reverse Convertible on Amazon.Com Rg	USD	5'000.00	20.04.2017	20.04.2018	36 016 653		-	100.000	100.000	20.07.	0.000	N
20.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
8.4 % Reverse Convertible on BHP Billiton Rg	CHF	1'000.00	20.09.2017	20.04.2018	37 560 184	%	98.910	100.000	100.000	20.10.	0.000	N
										20.11.	0.000	
										20.12.	0.000	
6.12 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.05.2017	23.04.2018	36 017 069	%	99.750	100.000	100.000	23.06.	0.000	N
										24.07.	0.000	
										23.08.	0.000	
										25.09.	0.000	
										23.10.	0.000	
										23.11.	0.000	
										27.12.	0.000	
4.15 % Reverse Convertible on Sunrise Comm Gr N	CHF	1'000.00	23.06.2017	23.04.2018	36 828 218	%	100.490	100.000	100.000	27.12.	0.000	N
8.04 % Reverse Convertible on BHP Billiton Rg	CHF	1'000.00	22.09.2017	23.04.2018	37 560 226	%	99.810	100.000	100.000	23.10.	0.000	N
										22.11.	0.000	
										22.12.	0.000	
4.65 % Reverse Convertible on Galenica N	CHF	10'000.00	04.05.2017	24.04.2018	36 016 759	%	101.170	100.000	100.000	06.11.	0.50958	N
3.18 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.02.2017	25.04.2018	35 119 097	%	100.510	100.000	100.000		0.000	N
13.82 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.07.2017	25.04.2018	36 828 628	%	101.170	100.000	100.000		0.000	N
11.35 % Reverse Convertible on Rio Tinto Sp ADR	USD	1'000.00	25.09.2017	25.04.2018	37 560 310	%	100.440	100.000	100.000		0.000	N
9.52 % Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	26.04.2017	26.04.2018	36 016 705		-	100.000	100.000	26.07.	21.095	N
26.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung										26.10.	21.922	
9.68 % Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	26.04.2017	26.04.2018	36 016 701		-	100.000	100.000	26.07.	21.095	N
26.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung										26.10.	21.922	
9 % Reverse Convertible on Anglo American Rg	CHF	1'000.00	26.09.2017	26.04.2018	37 560 330		-	100.000	100.000	26.10.	0.000	N
27.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung										27.11.	0.000	
4.33 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.04.2017	27.04.2018	36 016 698	%	98.850	100.000	100.000	26.10.	8.793	N
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.04.2017	27.04.2018	36 016 717	%	98.560	100.000	100.000	27.07.	0.000	N
										27.10.	0.000	
3.25 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	28.04.2017	30.04.2018	36 016 722	%	100.600	100.000	100.000	30.10.	0.05068	N
7.17 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.06.2017	30.04.2018	36 827 896	%	100.590	100.000	100.000	06.12.	0.000	N
7.17 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.06.2017	30.04.2018	36 827 893	%	100.530	100.000	100.000	06.12.	0.000	N
13.34 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.08.2017	30.04.2018	37 559 996	%	102.350	100.000	100.000		0.000	N
6.76 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	27.10.2017	30.04.2018	38 542 081	%	95.620	100.000	100.000		0.000	N
9.76 % Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	02.05.2017	02.05.2018	36 016 751	%	100.370	100.000	100.000	02.11.	44.508	N
7.04 % Reverse Convertible on Valeo	EUR	1'000.00	02.08.2017	02.05.2018	37 559 708	%	99.040	100.000	100.000	02.11.	0.000	N
8.08 % Reverse Convertible on Valeo	EUR	1'000.00	01.11.2017	02.05.2018	38 542 168	%	100.710	100.000	100.000		0.000	N
7.4 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	04.05.2017	04.05.2018	36 016 779	%	99.360	100.000	100.000	04.08.	0.000	N
										04.11.	0.000	
6.39 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.05.2017	04.05.2018	36 016 883	%	97.760	100.000	100.000	13.11.	0.000	N
7.53 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	05.05.2017	08.05.2018	36 016 796	%	101.780	100.000	100.000	06.11.	0.40832	N
7.35 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	05.05.2017	08.05.2018	36 016 795	%	101.490	100.000	100.000	06.11.	4.525	N
10.8 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	07.11.2017	08.05.2018	38 542 249	%	101.970	100.000	100.000		0.000	N
7.16 % Reverse Convertible on Infineon Technolo N	EUR	1'000.00	09.05.2017	09.05.2018	36 016 818	%	101.600	100.000	100.000	09.11.	0.05849	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
9.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	09.06.2017	09.05.2018	36 828 004		-	100.000	100.000	10.07. 09.08. 11.09. 09.10. 09.11.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
9.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
7.02 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.05.2017	11.05.2018	36 016 847	%	61.370	100.000	100.000	10.11.	8.925	N
6.24 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.05.2017	11.05.2018	36 016 950	%	99.270	100.000	100.000	17.11.	0.000	N
7.06 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	19.05.2017	11.05.2018	36 017 026	%	100.320	100.000	100.000	20.11.	0.000	N
6.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.11.2017	11.05.2018	38 542 314	%	99.570	100.000	100.000	11.12.	0.000	N
6.12 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.11.2017	11.05.2018	38 542 313	%	98.530	100.000	100.000	11.12.	0.000	N
12.6 % Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	12.05.2017	14.05.2018	36 016 903		-	100.000	100.000		0.000	N
14.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
8.44 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	19.05.2017	14.05.2018	36 017 013	%	101.120	100.000	100.000	20.11.	4.463	N
6.48 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.06.2017	14.05.2018	36 828 058	%	100.750	100.000	100.000	14.12.	0.000	N
6.98 % Reverse Convertible on Generali N	EUR	1'000.00	14.06.2017	14.05.2018	36 828 070	%	101.020	100.000	100.000	14.12.	0.000	N
8.59 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.10.2017	14.05.2018	38 541 835	%	98.700	100.000	100.000		0.000	N
7.8 % Reverse Convertible on Glencore Rg	CHF	1'000.00	13.10.2017	14.05.2018	37 560 574	%	99.730	100.000	100.000	13.12.	0.000	N
5.48 % Reverse Convertible on Rio Tinto Rg	GBP	1'000.00	13.11.2017	14.05.2018	38 542 339	%	99.610	100.000	100.000		0.000	N
14.24 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.08.2017	15.05.2018	37 559 827	%	83.090	100.000	100.000		0.000	N
16.88 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.08.2017	15.05.2018	37 559 828	%	83.180	100.000	100.000		0.000	N
4.41 % Reverse Convertible on Nestle N	CHF	1'000.00	16.11.2016	16.05.2018	34 015 644	%	101.280	100.000	100.000	16.11.	0.100	N
7 % Reverse Convertible on BHP Billiton Rg	GBP	1'000.00	15.11.2017	16.05.2018	38 542 377	%	99.970	100.000	100.000		0.000	N
0.75 % (pro rata) Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	CHF	1'000.00	18.05.2016	18.05.2018	26 829 334	%	99.270	100.000	100.000	18.02. 18.05. 18.08. 18.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
7.64 % Reverse Convertible on CieFinRichemont N	CHF	1'000.00	19.05.2017	22.05.2018	36 017 022		-	100.000	100.000		0.000	N
21.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
7.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	19.05.2017	22.05.2018	36 017 023	%	99.480	100.000	100.000	21.08. 20.11.	0.000 0.000	N
8.8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	19.05.2017	22.05.2018	36 017 030	%	99.850	100.000	100.000	21.08. 20.11.	0.000 0.000	N
3.92 % Reverse Convertible on Geberit N	CHF	5'000.00	22.05.2017	22.05.2018	36 017 043	%	99.680	100.000	100.000	22.08. 22.11.	0.000 0.000	N
6.36 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.05.2017	22.05.2018	36 017 035	%	101.340	100.000	100.000	22.11.	0.000	N
9 % Reverse Convertible on Tesla Rg	USD	5'000.00	22.05.2017	22.05.2018	36 017 041	%	98.480	100.000	100.000	22.08. 22.11.	21.294 21.633	N
9.43 % Reverse Convertible on GAM Hldg N	CHF	1'000.00	05.07.2017	22.05.2018	36 828 402	%	102.630	100.000	100.000		0.000	N
14.8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	21.08.2017	22.05.2018	37 559 870	%	85.520	100.000	100.000		0.000	N
7.2 % Reverse Convertible on Halliburton Rg	CHF	1'000.00	20.11.2017	22.05.2018	38 542 447	%	99.820	100.000	100.000	20.12.	0.000	N
7.92 % Reverse Convertible on Commerzbank I	CHF	1'000.00	20.11.2017	22.05.2018	38 542 445	%	99.710	100.000	100.000	20.12.	0.000	N
8.88 % Reverse Convertible on Fiat Chrysler Au Rg	CHF	1'000.00	20.11.2017	22.05.2018	38 542 384	%	98.870	100.000	100.000	20.12.	0.000	N
6.24 % Reverse Convertible on EDF	CHF	1'000.00	21.11.2017	22.05.2018	38 542 399	%	91.350	100.000	100.000	21.12.	0.000	N
8.52 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.05.2017	23.05.2018	36 017 077	%	100.010	100.000	100.000	23.08. 23.11.	0.000 0.000	N
3.12 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	24.05.2017	24.05.2018	36 017 086	%	98.900	100.000	100.000	24.08. 24.11.	0.000 0.000	N
10.96 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	24.05.2017	24.05.2018	36 017 095	%	99.140	100.000	100.000	24.08. 24.11.	0.000 0.000	N
4.72 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.05.2017	24.05.2018	36 017 075	%	91.730	100.000	100.000		0.000	N
8.76 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	24.05.2017	24.05.2018	36 017 097	%	99.520	100.000	100.000	24.08. 24.11.	0.000 0.000	N
5.48 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	19.05.2017	25.05.2018	36 017 007	%	100.350	100.000	100.000	20.11.	0.000	N
8.2 % Reverse Convertible on Volkswagen Vz I	EUR	1'000.00	30.05.2017	30.05.2018	36 017 100		-	100.000	100.000	30.08. 30.11.	0.000 0.000	N
30.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
8.1 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	30.05.2017	30.05.2018	36 827 781	%	98.940	100.000	100.000	30.11.	0.000	N
5.53 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.05.2017	30.05.2018	36 827 800	%	98.830	100.000	100.000	30.11.	8.514	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
11.08 % Reverse Convertible on Equities 30.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	5'000.00	30.05.2017	30.05.2018	36 827 795		-	100.000	100.000	30.08. 30.11.	0.000 0.000	N
9.79 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	28.11.2017	30.05.2018	38 542 567	%	101.590	100.000	100.000		0.000	N
7.12 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N 31.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	31.05.2017	31.05.2018	36 017 099		-	100.000	100.000	31.08.	0.000	N
9 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	31.05.2017	31.05.2018	36 827 793	%	90.750	100.000	100.000	31.08. 30.11.	0.000 0.000	N
11.72 % Reverse Convertible on Equities 30.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	31.05.2017	31.05.2018	36 827 796		-	100.000	100.000	31.08. 30.11.	0.000 0.000	N
6.12 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.05.2017	31.05.2018	36 827 826	%	99.000	100.000	100.000	30.11.	0.000	N
3.54 % Reverse Convertible on Nestle N	CHF	1'000.00	01.03.2017	01.06.2018	35 119 119	%	100.730	100.000	100.000		0.000	N
10.08 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	01.06.2017	01.06.2018	36 827 832	%	96.100	100.000	100.000	01.12.	0.000	N
(no min.) Notes on Ibex 35-Index	USD	1'000.00	04.06.2015	04.06.2018	12 791 334	%	94.770	96.440	100.000		0.000	Y
1.25 % (5 % p.a.) Reverse Convertible on Euro Stoxx 50	CHF	1'000.00	03.06.2016	04.06.2018	22 906 367	%	100.490	100.000	100.000	03.03. 06.06. 04.09. 04.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
7.75 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.05.2017	04.06.2018	36 016 974	%	98.240	100.000	100.000		0.000	N
9.37 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.06.2017	04.06.2018	36 827 769	%	100.640	100.000	100.000	04.12.	0.000	N
6.73 % Reverse Convertible on Dufry N	CHF	1'000.00	02.06.2017	04.06.2018	36 827 876	%	96.740	100.000	100.000	04.12.	0.000	N
9.6 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.06.2017	04.06.2018	36 827 873	%	93.870	100.000	100.000		0.000	N
8.19 % Reverse Convertible on AXA	EUR	1'000.00	03.07.2017	04.06.2018	36 828 365	%	99.930	100.000	100.000		0.000	N
6.43 % Reverse Convertible on Sulzer N	CHF	1'000.00	03.10.2017	04.06.2018	37 560 441	%	100.720	100.000	100.000		0.000	N
9.96 % Reverse Convertible on Equities	EUR	5'000.00	02.11.2017	04.06.2018	38 542 180	%	96.060	100.000	100.000		0.000	N
0.75 % Notes on Euro Stoxx 50-Index	CHF	1'000.00	05.06.2015	05.06.2018	12 791 309	%	100.960	100.000	100.000	07.03. 07.06. 07.09. 07.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
6.48 % Reverse Convertible on Equities 6.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	06.06.2017	06.06.2018	36 827 885		-	100.000	100.000	06.09. 06.12.	0.000 0.000	N
6.25 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.06.2017	06.06.2018	36 827 891	%	98.610	100.000	100.000	06.12.	0.000	N
8.01 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.06.2017	06.06.2018	36 827 883	%	98.840	100.000	100.000	06.12.	0.000	N
6.52 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	06.06.2017	06.06.2018	36 827 884	%	98.290	100.000	100.000	06.09. 06.12.	0.000 0.000	N
6.48 % Reverse Convertible on Facebook-A 6.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	06.06.2017	06.06.2018	36 827 911		-	100.000	100.000	06.09.	0.000	N
6.57 % Reverse Convertible on Dufry N	CHF	1'000.00	06.10.2017	06.06.2018	37 560 542	%	97.290	100.000	100.000		0.000	N
7.76 % Reverse Convertible on Equities	CHF	20'000.00	07.06.2017	07.06.2018	36 827 898	%	100.000	100.000	100.000	07.12.	0.000	N
8.91 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.06.2017	07.06.2018	36 827 943	%	100.120	100.000	100.000	07.12.	8.563	N
7.26 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	07.06.2017	07.06.2018	36 827 897	%	99.210	100.000	100.000	07.12.	0.000	N
8.57 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.06.2017	07.06.2018	36 827 894	%	103.250	100.000	100.000	07.12.	0.000	N
5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.06.2017	07.06.2018	36 827 950	%	100.400	100.000	100.000	07.12.	0.000	N
9.35 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	07.06.2017	07.06.2018	36 827 906	%	99.200	100.000	100.000	07.12.	0.000	N
4.31 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.05.2017	08.06.2018	36 016 884	%	100.510	100.000	100.000		0.000	N
4.68 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.05.2017	08.06.2018	36 016 970	%	100.620	100.000	100.000		0.000	N
8.96 % Reverse Convertible on Equities 8.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	08.06.2017	08.06.2018	36 827 952		-	100.000	100.000	08.09.	0.000	N
8.44 % Reverse Convertible on Equities 8.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	08.06.2017	08.06.2018	36 827 974		-	100.000	100.000	08.09.	4.075	N
6.8 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	08.06.2017	08.06.2018	36 827 966	%	100.720	100.000	100.000	08.09. 08.12.	1.999 2.128	N
9.88 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.06.2017	08.06.2018	36 827 973	%	99.110	100.000	100.000	08.09. 08.12.	4.075 4.276	N
7.13 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	09.06.2017	11.06.2018	36 827 965	%	99.780	100.000	100.000	11.12.	0.000	N
12 % Reverse Convertible on Equities	USD	10'000.00	09.06.2017	11.06.2018	36 828 012	%	98.620	100.000	100.000	11.09. 11.12.	0.000 0.000	N
5.72 % Reverse Convertible on GlaxoSmithKline Rg	GBP	1'000.00	09.06.2017	11.06.2018	36 828 014	%	77.270	100.000	100.000	11.12.	0.000	N
4 % Reverse Convertible on Sainsbury Rg	GBP	1'000.00	09.06.2017	11.06.2018	36 828 003	%	96.730	100.000	100.000	11.12.	4.225	N
4.91 % Reverse Convertible on CS Group N	CHF	1'000.00	09.06.2017	11.06.2018	36 827 845	%	101.630	100.000	100.000	11.12.	0.000	N
6.47 % Reverse Convertible on Dufry N	CHF	1'000.00	09.10.2017	11.06.2018	37 560 555	%	97.000	100.000	100.000		0.000	N
11.27 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	12.06.2017	12.06.2018	36 828 000	%	101.410	100.000	100.000	12.12.	0.000	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
7.23 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	12.06.2017	12.06.2018	36 828 010	%	98.820	100.000	100.000	12.12.	0.000	N
3 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.06.2017	12.06.2018	36 828 020	%	98.650	100.000	100.000	12.09. 12.12.	0.00229 0.00232	N
7.05 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	12.10.2017	12.06.2018	38 541 805	%	100.030	100.000	100.000		0.000	N
4.09 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	13.06.2017	13.06.2018	36 828 040	%	99.940	100.000	100.000	13.12.	0.000	N
9 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.06.2017	13.06.2018	36 828 039	%	97.030	100.000	100.000	13.12.	0.000	N
6.46 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.06.2017	13.06.2018	36 828 043	%	101.060	100.000	100.000	13.12.	0.000	N
10 % Reverse Convertible on Equities 13.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	13.06.2017	13.06.2018	36 828 041		-	100.000	100.000	13.09. 13.12.	0.000 0.000	N
11.8 % Reverse Convertible on Equities 13.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	13.06.2017	13.06.2018	36 828 042		-	100.000	100.000	13.12.	34.307	N
7.32 % Reverse Convertible on Renault	EUR	1'000.00	13.11.2017	13.06.2018	38 542 323	%	94.880	100.000	100.000	13.12.	0.000	N
9.6 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.06.2017	14.06.2018	36 827 953	%	100.300	100.000	100.000	14.09. 14.12.	0.000 0.000	N
10.56 % Reverse Convertible on Alexion Pharm Rg	CHF	1'000.00	14.06.2017	14.06.2018	36 828 074	%	100.970	100.000	100.000	14.12.	0.000	N
8.76 % Reverse Convertible on UniCredit N 14.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	14.06.2017	14.06.2018	36 827 955		-	100.000	100.000	14.09.	0.000	N
8.72 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.06.2017	15.06.2018	36 827 954	%	92.950	100.000	100.000	15.09. 15.12.	0.000 0.000	N
5.17 % Reverse Convertible on Sulzer N	CHF	1'000.00	15.06.2017	15.06.2018	36 828 079	%	100.780	100.000	100.000	15.12.	0.000	N
5.13 % Reverse Convertible on Sulzer N	CHF	1'000.00	15.06.2017	15.06.2018	36 828 095	%	100.660	100.000	100.000	15.12.	0.000	N
6.8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.09.2017	15.06.2018	37 560 196	%	100.730	100.000	100.000	15.12.	0.000	N
9.89 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	16.06.2017	18.06.2018	36 828 104	%	102.880	100.000	100.000	18.12.	0.000	N
9.8 % Reverse Convertible on Equities 18.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	16.06.2017	18.06.2018	36 828 106		-	100.000	100.000	18.09.	0.000	N
3.84 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	16.06.2017	18.06.2018	36 828 112	%	99.710	100.000	100.000	18.09. 18.12.	0.000 0.000	N
11.23 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.06.2017	18.06.2018	36 828 101	%	99.760	100.000	100.000	18.12.	0.000	N
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	16.06.2017	18.06.2018	36 828 108	%	99.380	100.000	100.000	18.09. 18.12.	0.000 0.000	N
8.28 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.06.2017	18.06.2018	36 828 115	%	97.480	100.000	100.000	18.12.	0.000	N
14.76 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.09.2017	18.06.2018	37 560 218	%	88.870	100.000	100.000		0.000	N
11.16 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.10.2017	18.06.2018	38 541 874	%	97.620	100.000	100.000		0.000	N
8.8 % Reverse Convertible on Banco Santander Rg	USD	1'000.00	17.11.2017	18.06.2018	38 542 427	%	98.620	100.000	100.000		0.000	N
7.14 % Reverse Convertible on Renault	USD	1'000.00	17.11.2017	18.06.2018	38 542 428	%	99.120	100.000	100.000		0.000	N
7.27 % Reverse Convertible on Equities	CHF	20'000.00	19.06.2017	19.06.2018	36 828 127	%	101.380	100.000	100.000	19.12.	0.000	N
10.19 % Reverse Convertible on Alexion Pharm Rg	CHF	1'000.00	19.06.2017	19.06.2018	36 828 136	%	100.470	100.000	100.000	19.12.	0.000	N
7.28 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.03.2017	20.06.2018	36 016 142	%	100.730	100.000	100.000	20.06. 20.09. 20.12.	0.000 0.000 0.000	N
3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	20.04.2017	20.06.2018	36 016 518	%	99.650	100.000	100.000	20.06. 21.08. 20.10. 20.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
3 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.06.2017	20.06.2018	36 828 144	%	98.410	100.000	100.000	20.09. 20.12.	0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	20.06.2017	20.06.2018	36 828 077	%	99.210	100.000	100.000	20.09. 20.12.	0.000 0.000	N
9.36 % Reverse Convertible on Equities 21.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	21.12.2016	21.06.2018	34 016 051		-	100.000	100.000	21.06. 21.09. 21.12.	0.000 0.000 0.000	N
7.47 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	22.06.2017	22.06.2018	36 828 189	%	100.920	100.000	100.000	22.12.	0.000	N
9.27 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	22.06.2017	22.06.2018	36 828 191	%	102.580	100.000	100.000	22.12.	0.000	N
5.59 % Reverse Convertible on BNP Paribas-A-	CHF	1'000.00	22.06.2017	22.06.2018	36 828 198	%	100.020	100.000	100.000	22.12.	0.000	N
6.19 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	22.06.2017	22.06.2018	36 828 202	%	101.280	100.000	100.000	22.12.	0.000	N
9.91 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	22.06.2017	22.06.2018	36 828 207	%	102.770	100.000	100.000	22.12.	0.000	N
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	22.06.2017	22.06.2018	36 828 133	%	99.390	100.000	100.000	22.09. 22.12.	0.000 0.000	N
8.38 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.09.2017	22.06.2018	37 560 298	%	99.160	100.000	100.000		0.000	N
Note on Euro Stoxx 50-Index	EUR	1'000.00	25.04.2014	25.06.2018	22 905 982	%	107.670	93.950	97.000		0.000	Y
10.64 % Reverse Convertible on Equities 25.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	NOK	10'000.00	23.06.2017	25.06.2018	36 828 214		-	100.000	100.000	25.09.	0.000	N
5.7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	23.06.2017	25.06.2018	36 828 212	%	100.930	100.000	100.000	27.12.	0.000	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
9.68 % Reverse Convertible on UniCredit N 25.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	23.06.2017	25.06.2018	36 828 230		-	100.000	100.000	25.09.	0.000	N
9.68 % Reverse Convertible on UniCredit N 25.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	23.06.2017	25.06.2018	36 828 228		-	100.000	100.000	25.09.	0.000	N
10.24 % Reverse Convertible on Vallourec	EUR	1'000.00	23.06.2017	25.06.2018	36 828 229	%	98.460	100.000	100.000		0.000	N
9.11 % Reverse Convertible on Equities	CHF	20'000.00	23.06.2017	25.06.2018	36 828 213	%	101.940	100.000	100.000	27.12.	0.000	N
8.64 % Reverse Convertible on EDF	EUR	1'000.00	24.11.2017	25.06.2018	38 542 526	%	97.880	100.000	100.000	27.12.	0.000	N
3.9 % Reverse Convertible on BASF N	CHF	1'000.00	26.06.2017	26.06.2018	36 828 239	%	99.490	100.000	100.000	27.12.	0.000	N
4 % Reverse Convertible on Bayer N	CHF	1'000.00	26.06.2017	26.06.2018	36 828 240	%	88.940	100.000	100.000	27.12.	0.000	N
9.75 % Reverse Convertible on BHP Billiton Rg	GBP	1'000.00	26.06.2017	26.06.2018	36 828 234	%	103.350	100.000	100.000	27.12.	4.205	N
6.93 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	26.06.2017	26.06.2018	36 828 250	%	99.670	100.000	100.000	27.12.	0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	26.06.2017	26.06.2018	36 828 235	%	99.810	100.000	100.000	27.12.	0.000	N
7.11 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.06.2017	26.06.2018	36 828 242	%	98.560	100.000	100.000	27.12.	0.000	N
Lookback Certificate on S&P 500 Index	USD	1'588.19	27.06.2013	27.06.2018	11 862 963	CHF	2551.410	92.820	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible on Roche Hldg G	CHF	5'000.00	27.03.2017	27.06.2018	36 016 263	%	99.460	100.000	100.000	27.06. 27.09. 27.12.	0.000 0.000 0.000	N
5.57 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.06.2017	27.06.2018	36 828 285	%	100.550	100.000	100.000	27.12.	0.000	N
10.6 % Reverse Convertible on Equities	NOK	10'000.00	27.06.2017	27.06.2018	36 828 279	%	103.460	100.000	100.000	27.12.	7.717	N
14.72 % Reverse Convertible on Equities 28.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	28.06.2017	28.06.2018	36 828 304		-	100.000	100.000		0.000	N
5.04 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	28.06.2017	28.06.2018	36 828 215	%	99.040	100.000	100.000		0.000	N
11.75 % Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	28.06.2017	28.06.2018	36 828 249	%	101.810	100.000	100.000	28.12.	42.458	N
6.39 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.06.2017	28.06.2018	36 828 296	%	100.640	100.000	100.000	28.12.	0.000	N
7.57 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.06.2017	28.06.2018	36 828 297	%	99.760	100.000	100.000	28.12.	8.540	N
6.53 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	28.06.2017	28.06.2018	36 828 298	%	99.260	100.000	100.000	28.12.	0.000	N
5 % Reverse Convertible on BHP Billiton Rg	GBP	1'000.00	28.06.2017	28.06.2018	36 828 292	%	101.480	100.000	100.000	28.12.	4.089	N
4.29 % Reverse Convertible on Royal Dutch Shell-B	GBP	1'000.00	28.11.2017	28.06.2018	38 542 565	%	100.050	100.000	100.000		0.000	N
6.3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	29.06.2017	29.06.2018	36 828 311	%	100.980	100.000	100.000	29.12.	0.000	N
8.48 % Reverse Convertible on Commerzbank I 29.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	29.06.2017	29.06.2018	36 828 312		-	100.000	100.000	29.09.	0.000	N
10.16 % Reverse Convertible on Equities 29.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	29.06.2017	29.06.2018	36 828 325		-	100.000	100.000		0.000	N
9.64 % Reverse Convertible on Equities 29.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	29.06.2017	29.06.2018	36 828 324		-	100.000	100.000	29.09.	0.000	N
6.94 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	29.06.2017	29.06.2018	36 828 327	%	99.470	100.000	100.000	29.12.	0.000	N
6.94 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	29.06.2017	29.06.2018	36 828 316	%	99.500	100.000	100.000	29.12.	0.000	N
10 % Reverse Convertible on Equities 29.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	29.06.2017	29.06.2018	36 828 333		-	100.000	100.000		0.000	N
7.24 % Reverse Convertible on Equities 29.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	29.06.2017	29.06.2018	36 828 340		-	100.000	100.000		0.000	N
6.44 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.06.2017	29.06.2018	36 828 341	%	65.420	100.000	100.000		0.000	N
10.06 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	29.06.2017	29.06.2018	36 828 315	%	98.020	100.000	100.000	29.12.	0.000	N
4.63 % Reverse Convertible on Sunrise Comm Gr N	CHF	1'000.00	29.06.2017	29.06.2018	36 828 307	%	101.010	100.000	100.000	29.12.	0.000	N
5.12 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	30.03.2017	02.07.2018	36 016 337	%	98.860	100.000	100.000	30.06. 30.09. 30.12.	0.000 0.000 0.000	N
7.64 % Reverse Convertible on Equities 2.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.06.2017	02.07.2018	36 828 362		-	100.000	100.000	02.10.	0.000	N
11.88 % Reverse Convertible on Equities 2.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.06.2017	02.07.2018	36 828 364		-	100.000	100.000	02.10.	0.000	N
8.34 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.10.2017	02.07.2018	37 560 434	%	101.060	100.000	100.000		0.000	N
8.81 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	02.10.2017	02.07.2018	37 560 432	%	98.780	100.000	100.000		0.000	N
10.93 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.07.2017	04.07.2018	36 828 381	%	99.260	100.000	100.000		0.000	N
11.64 % Reverse Convertible on Equities 4.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	04.07.2017	04.07.2018	36 828 391		-	100.000	100.000	04.10.	0.000	N
6.95 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	04.07.2017	04.07.2018	36 828 394	%	99.190	100.000	100.000		0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.07.2017	04.07.2018	36 828 396	%	102.140	100.000	100.000		0.000	N
6.48 % Reverse Convertible on Clariant N 4.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	04.07.2017	04.07.2018	36 828 380		-	100.000	100.000		0.000	N
6.91 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	04.07.2017	04.07.2018	36 828 383	%	99.000	100.000	100.000		0.000	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	05.07.2017	05.07.2018	36 828 395	%	63.590	100.000	100.000		0.000	N
8 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.07.2017	05.07.2018	36 828 400	%	97.350	100.000	100.000		0.000	N
7.96 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.12.2017	05.07.2018	38 542 655	%	99.520	100.000	100.000		0.000	N
8.09 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.12.2017	05.07.2018	38 542 659	%	98.800	100.000	100.000		0.000	N
9.47 % Reverse Convertible on Equities	CHF	20'000.00	06.07.2017	06.07.2018	36 828 433	%	103.050	100.000	100.000		0.000	N
5.72 % Reverse Convertible on Equities 6.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	06.07.2017	06.07.2018	36 828 445		-	100.000	100.000		0.000	N
7.47 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.07.2017	06.07.2018	36 828 434	%	98.850	100.000	100.000		0.000	N
5.1 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	06.07.2017	06.07.2018	36 828 440	%	100.020	100.000	100.000		0.000	N
1.25 % (5 % p.a.) Reverse Convertible on Euro Stoxx 50	CHF	1'000.00	08.07.2016	09.07.2018	22 906 377	%	102.160	100.000	100.000	11.01. 11.04. 11.07. 11.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
8.61 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.06.2017	09.07.2018	36 827 948	%	100.370	100.000	100.000		0.000	N
8.2 % Reverse Convertible on Equities 9.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	07.07.2017	09.07.2018	36 828 457		-	100.000	100.000	09.10.	0.000	N
7.84 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.07.2017	09.07.2018	36 828 453	%	93.430	100.000	100.000		0.000	N
8.48 % Reverse Convertible on Equities 9.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	07.07.2017	09.07.2018	36 828 455		-	100.000	100.000	09.10.	0.000	N
10.32 % Reverse Convertible on Equities 9.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.07.2017	09.07.2018	36 828 458		-	100.000	100.000	09.10.	0.000	N
10.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.07.2017	09.07.2018	36 828 454	%	99.810	100.000	100.000	09.10.	0.000	N
8.2 % Reverse Convertible on Equities 9.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	07.07.2017	09.07.2018	36 828 456		-	100.000	100.000	09.10.	0.000	N
6.16 % Reverse Convertible on Halliburton Rg 10.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	07.07.2017	09.07.2018	36 828 443		-	100.000	100.000		0.000	N
7.17 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	07.07.2017	09.07.2018	36 828 451	%	100.050	100.000	100.000		0.000	N
10.36 % Reverse Convertible on Equities 9.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.07.2017	09.07.2018	36 828 459		-	100.000	100.000	09.10.	0.000	N
10.58 % Reverse Convertible on GAM Hldg N	CHF	1'000.00	09.10.2017	09.07.2018	37 560 556	%	99.990	100.000	100.000		0.000	N
9.03 % Reverse Convertible on Fiat Chrysler Au Rg	EUR	1'000.00	07.12.2017	09.07.2018	38 542 687	%	99.340	100.000	100.000		0.000	N
8.99 % Reverse Convertible on Equities 10.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	10.05.2017	10.07.2018	36 016 793		-	100.000	100.000	10.07. 11.09.	0.000 0.000	N
8.09 % Reverse Convertible on Equities 10.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	10.05.2017	10.07.2018	36 016 805		-	100.000	100.000	10.07. 10.09. 10.11.	0.000 0.000 0.000	N
6.52 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.07.2017	10.07.2018	36 828 465	%	100.670	100.000	100.000		0.000	N
8.16 % Reverse Convertible on Equities 10.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	10.07.2017	10.07.2018	36 828 471		-	100.000	100.000	10.10.	3.409	N
10.25 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.07.2017	10.07.2018	36 828 358	%	100.910	100.000	100.000		0.000	N
4.92 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.01.2017	11.07.2018	35 118 427	%	101.300	100.000	100.000	11.07.	0.000	N
6.22 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.01.2017	11.07.2018	35 118 428	%	101.670	100.000	100.000	11.07.	0.000	N
5.2 % Reverse Convertible on Equities 11.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.07.2017	11.07.2018	36 828 497		-	100.000	100.000		0.000	N
7.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	12.07.2017	12.07.2018	36 828 513	%	96.050	100.000	100.000		0.000	N
9.8 % Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	12.07.2017	12.07.2018	36 828 529	%	98.420	100.000	100.000	12.10.	119.58	N
7.2 % Reverse Convertible on Equities 12.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	10'000.00	12.07.2017	12.07.2018	36 828 508		-	100.000	100.000		0.000	N
11.88 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	12.10.2017	12.07.2018	38 541 822	%	99.770	100.000	100.000	13.11. 12.12.	0.000 0.000	N
3.6 % p.a. Reverse Convertible on Vodafone Group	GBP	1'000.00	13.07.2016	13.07.2018	29 018 406	%	99.350	100.000	100.000	13.07. 13.10.	11.263 11.668	N
8.92 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	13.10.2017	13.07.2018	38 541 830	%	98.810	100.000	100.000		0.000	N
11.88 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.10.2017	13.07.2018	38 541 828	%	99.750	100.000	100.000	13.11. 13.12.	0.000 0.000	N
5.63 % Reverse Convertible on Mondelez Intl Rg-A	USD	1'000.00	14.07.2017	16.07.2018	36 828 588	%	99.500	100.000	100.000		0.000	N
11.8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.10.2017	16.07.2018	38 541 855	%	99.870	100.000	100.000		0.000	N
13 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.10.2017	16.07.2018	38 541 849	%	98.780	100.000	100.000		0.000	N
11.96 % Reverse Convertible on Equities 17.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	17.07.2017	17.07.2018	36 828 602		-	100.000	100.000	17.10.	0.000	N
9.66 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	17.11.2017	17.07.2018	38 542 422	%	101.260	100.000	100.000		0.000	N
11.47 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	17.11.2017	17.07.2018	38 542 429	%	101.630	100.000	100.000		0.000	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
8.37 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.07.2017	18.07.2018	36 828 617	%	97.520	100.000	100.000		0.000	N
8.52 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.07.2017	18.07.2018	36 828 618	%	99.250	100.000	100.000		0.000	N
6.04 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.07.2017	18.07.2018	36 828 619	%	101.750	100.000	100.000		0.000	N
7.28 % Reverse Convertible on Equities 18.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.07.2017	18.07.2018	36 828 627		-	100.000	100.000	18.10.	0.000	N
9.92 % Reverse Convertible on Equities 18.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.07.2017	18.07.2018	36 828 625		-	100.000	100.000	18.10.	0.000	N
9.68 % Reverse Convertible on Equities 18.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.07.2017	18.07.2018	36 828 626		-	100.000	100.000		0.000	N
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	18.07.2017	18.07.2018	36 828 622	%	98.200	100.000	100.000		0.000	N
5.46 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.07.2017	19.07.2018	36 828 632	%	99.470	100.000	100.000		0.000	N
5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.07.2017	19.07.2018	36 828 648	%	99.880	100.000	100.000		0.000	N
12.08 % Reverse Convertible on Equities 19.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	19.07.2017	19.07.2018	36 828 660		-	100.000	100.000	19.10.	0.000	N
5.92 % Reverse Convertible on Equities 19.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	20'000.00	19.07.2017	19.07.2018	36 828 637		-	100.000	100.000		0.000	N
10.43 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	19.07.2017	19.07.2018	36 828 655	%	102.510	100.000	100.000		0.000	N
5.66 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	19.09.2017	19.07.2018	37 560 227	%	98.450	100.000	100.000		0.000	N
5.76 % Reverse Convertible on The Swatch Grp 20.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	20.01.2017	20.07.2018	35 118 559		-	100.000	100.000	20.04.	0.000	N
11.08 % Reverse Convertible on Equities 20.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	20.04.2017	20.07.2018	36 016 613		-	100.000	100.000		0.000	N
11.08 % Reverse Convertible on Equities 20.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	20.04.2017	20.07.2018	36 016 619		-	100.000	100.000	20.07.	0.000	N
6.18 % Reverse Convertible on Equities	CHF	20'000.00	20.07.2017	20.07.2018	36 828 671	%	101.850	100.000	100.000		0.000	N
5.56 % Reverse Convertible on The Swatch Grp I 20.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	20.07.2017	20.07.2018	36 828 681		-	100.000	100.000	20.10.	0.000	N
10.32 % Reverse Convertible on Equities 21.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	21.04.2017	23.07.2018	36 016 650		-	100.000	100.000	21.07.	0.000	N
5.44 % Reverse Convertible on The Swatch Grp I 23.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	21.07.2017	23.07.2018	36 828 693		-	100.000	100.000	23.10.	0.000	N
9.05 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.07.2017	23.07.2018	36 828 668	%	98.940	100.000	100.000		0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	21.09.2017	23.07.2018	37 560 258	%	100.730	100.000	100.000		0.000	N
10.46 % Reverse Convertible on Equities	CHF	20'000.00	24.07.2017	24.07.2018	36 828 720	%	103.010	100.000	100.000		0.000	N
4.53 % Reverse Convertible on Royal Dutch Shell-B	GBP	1'000.00	24.07.2017	24.07.2018	36 828 718	%	101.270	100.000	100.000		0.000	N
10.77 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.07.2017	25.07.2018	36 828 649	%	101.580	100.000	100.000		0.000	N
5.43 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	25.07.2017	25.07.2018	36 828 651	%	100.010	100.000	100.000		0.000	N
9 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	25.07.2017	25.07.2018	36 828 740	%	102.200	100.000	100.000		0.000	N
5.06 % Reverse Convertible on Statoil Rg	NOK	10'000.00	25.07.2017	25.07.2018	36 828 732	%	101.740	100.000	100.000		0.000	N
8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	25.07.2017	25.07.2018	36 828 731	%	99.480	100.000	100.000		0.000	N
12.92 % Reverse Convertible on Equities 27.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	27.04.2017	27.07.2018	36 016 715		-	100.000	100.000	27.07.	0.000	N
6 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.07.2017	27.07.2018	37 559 634	%	99.290	100.000	100.000		0.000	N
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	27.07.2017	27.07.2018	37 559 636	%	97.760	100.000	100.000		0.000	N
6.16 % Reverse Convertible on Clariant N 27.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	27.07.2017	27.07.2018	37 559 622		-	100.000	100.000	27.10.	15.400	N
11.32 % Reverse Convertible on Anadarko Petrole Rg 27.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	27.07.2017	27.07.2018	37 559 644		-	100.000	100.000	27.10.	2.498	N
7.07 % Reverse Convertible on Equities 31.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	30.03.2017	30.07.2018	36 016 336		-	100.000	100.000	30.05. 31.07.	0.000 0.000	N
4.5 % Reverse Convertible on The Kraft Heinz Rg	USD	1'000.00	28.07.2017	30.07.2018	37 559 657	%	94.940	100.000	100.000		0.000	N
9.45 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.07.2017	30.07.2018	37 559 656	%	101.630	100.000	100.000		0.000	N
7.35 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.07.2017	30.07.2018	37 559 655	%	97.390	100.000	100.000		0.000	N
10.97 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.07.2017	30.07.2018	37 559 645	%	102.340	100.000	100.000		0.000	N
5 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	28.09.2017	30.07.2018	37 560 388	%	91.950	100.000	100.000		0.000	N
4 % Reverse Convertible (exp.24.7.18) on Shares-Basket	CHF	1'000.00	31.07.2015	31.07.2018	26 829 271	%	86.480	100.000	100.000	29.07.	0.000	N
3.35 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.05.2017	31.07.2018	36 017 082	%	100.660	100.000	100.000		0.000	N
4.73 % Reverse Convertible on Logitech Intl N	CHF	1'000.00	02.08.2017	02.08.2018	37 559 695	%	98.720	100.000	100.000		0.000	N
6.34 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.08.2017	02.08.2018	37 559 688	%	99.060	100.000	100.000		0.000	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.8 % Reverse Convertible on Equities 3.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	03.02.2017	03.08.2018	35 118 783		-	100.000	100.000	03.05. 03.08.	3.340 3.263	N
6.44 % Reverse Convertible on Equities 3.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	03.02.2017	03.08.2018	35 118 782		-	100.000	100.000	03.05. 03.08.	3.340 3.263	N
10.01 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.08.2017	03.08.2018	37 559 721	%	99.250	100.000	100.000		0.000	N
4.61 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	03.08.2017	03.08.2018	37 559 709	%	100.090	100.000	100.000		0.000	N
10.45 % Reverse Convertible on Equities	NOK	10'000.00	03.11.2017	03.08.2018	38 542 195	%	98.440	100.000	100.000		0.000	N
Capital Protected Note on Shares-Basket	USD	1'000.00	05.08.2014	06.08.2018	22 906 059	%	106.940	94.110	100.000		0.000	Y
7.18 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.08.2017	06.08.2018	37 559 734	%	72.510	100.000	100.000		0.000	N
10.21 % Reverse Convertible on General Motors Rg	USD	1'000.00	07.02.2017	07.08.2018	35 118 828	%	101.300	100.000	100.000		0.000	N
8.89 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.02.2017	07.08.2018	35 118 743	%	100.070	100.000	100.000		0.000	N
6.02 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.08.2017	07.08.2018	37 559 730	%	98.040	100.000	100.000		0.000	N
9.84 % Reverse Convertible on Logitech Intl N 8.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.08.2017	08.08.2018	37 559 741		-	100.000	100.000	08.11.	0.000	N
7.24 % Reverse Convertible on Sunrise Comm Gr N 8.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.08.2017	08.08.2018	37 559 740		-	100.000	100.000	08.11.	0.000	N
6.72 % Reverse Convertible on Equities 8.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.08.2017	08.08.2018	37 559 737		-	100.000	100.000	08.11.	0.000	N
4.5 % Reverse Convertible on Hennes&Mauritz -B-	SEK	10'000.00	09.08.2017	09.08.2018	37 559 756	%	84.470	100.000	100.000		0.000	N
10.11 % Reverse Convertible on Equities	NOK	10'000.00	09.08.2017	09.08.2018	37 559 752	%	103.370	100.000	100.000		0.000	N
4.5 % Reverse Convertible on Sandvik Br	SEK	10'000.00	09.08.2017	09.08.2018	37 559 757	%	100.690	100.000	100.000		0.000	N
9.42 % Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	09.08.2017	09.08.2018	37 559 759	%	101.490	100.000	100.000		0.000	N
11.24 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.08.2017	09.08.2018	37 559 766	%	98.090	100.000	100.000		0.000	N
7.8 % Reverse Convertible on Equities 10.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	10.02.2017	10.08.2018	35 118 892		-	100.000	100.000	10.08.	0.000	N
11.22 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.02.2017	13.08.2018	35 118 906	%	78.980	100.000	100.000		0.000	N
11.12 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.08.2017	13.08.2018	37 559 799	%	98.850	100.000	100.000		0.000	N
12 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.08.2017	13.08.2018	37 559 802	%	99.420	100.000	100.000		0.000	N
11.21 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.08.2017	13.08.2018	37 559 800	%	98.900	100.000	100.000		0.000	N
11.84 % Reverse Convertible on Equities 13.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	5'000.00	11.08.2017	13.08.2018	37 559 798		-	100.000	100.000	13.11.	0.000	N
10.65 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	11.08.2017	13.08.2018	37 559 795	%	100.420	100.000	100.000		0.000	N
3.5 % Reverse Convertible on The Kraft Heinz Rg	USD	1'000.00	14.08.2017	14.08.2018	37 559 808	%	93.720	100.000	100.000		0.000	N
5.14 % Reverse Convertible on Banco Santander Rg	EUR	1'000.00	15.08.2017	15.08.2018	37 559 816	%	96.130	100.000	100.000		0.000	N
4.78 % Reverse Convertible on AXA	EUR	1'000.00	15.08.2017	15.08.2018	37 559 817	%	97.250	100.000	100.000		0.000	N
6.97 % Reverse Convertible on Logitech Intl N	CHF	1'000.00	15.08.2017	15.08.2018	37 559 814	%	95.100	100.000	100.000		0.000	N
5.48 % Reverse Convertible on Enel N	EUR	1'000.00	15.08.2017	15.08.2018	37 559 815	%	97.370	100.000	100.000		0.000	N
3.95 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	16.08.2017	16.08.2018	37 559 839	%	100.320	100.000	100.000		0.000	N
8 % Reverse Convertible on Equities 17.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	17.05.2017	17.08.2018	36 016 981		-	100.000	100.000	17.08.	3.533	N
9.41 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	17.08.2017	17.08.2018	37 559 840	%	99.160	100.000	100.000		0.000	N
5.96 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.07.2017	20.08.2018	36 828 462	%	99.360	100.000	100.000		0.000	N
9.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	21.08.2017	21.08.2018	37 559 873	%	100.600	100.000	100.000		0.000	N
6.23 % Reverse Convertible on Valeo	EUR	1'000.00	21.08.2017	21.08.2018	37 559 866	%	100.840	100.000	100.000		0.000	N
6.72 % Reverse Convertible on CieFinRichemont N 22.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	22.08.2017	22.08.2018	37 559 878		-	100.000	100.000	22.11.	0.000	N
8.18 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	21.09.2017	22.08.2018	37 560 262	%	97.590	100.000	100.000		0.000	N
10.4 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.05.2017	23.08.2018	36 017 055	%	97.410	100.000	100.000	23.08. 23.11.	0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	23.08.2017	23.08.2018	37 559 904	%	98.440	100.000	100.000	23.11.	0.000	N
8.64 % Reverse Convertible on Equities	CHF	20'000.00	23.08.2017	23.08.2018	37 559 896	%	103.390	100.000	100.000		0.000	N
3.49 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.07.2017	24.08.2018	37 559 623	%	100.040	100.000	100.000		0.000	N
Capped Growth Note on Basket	USD	1'000.00	27.08.2013	27.08.2018	11 863 019	%	100.590	88.123	95.000		0.000	Y
Capped Growth Note on Basket	GBP	1'000.00	27.08.2013	27.08.2018	11 863 018	%	101.560	87.978	95.000		0.000	Y
3.3 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.02.2017	28.08.2018	35 119 098	%	100.960	100.000	100.000		0.000	N
Bonus Certificate on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	29.08.2014	29.08.2018	22 906 063	CHF	1610.690	98.350	100.000		0.000	Y
9.29 % Reverse Convertible on Equities	NOK	10'000.00	29.08.2017	29.08.2018	37 559 973	%	103.200	100.000	100.000		0.000	N
8.58 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.08.2017	29.08.2018	37 559 979	%	99.990	100.000	100.000		0.000	N
8.9 % Reverse Convertible on Equities	NOK	10'000.00	29.08.2017	29.08.2018	37 559 974	%	101.730	100.000	100.000		0.000	N
5.23 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	29.08.2017	29.08.2018	37 559 956	%	101.150	100.000	100.000		0.000	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
7.89 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	30.08.2017	30.08.2018	37 559 984	%	100.550	100.000	100.000		0.000	N
5.26 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	30.08.2017	30.08.2018	37 559 990	%	99.000	100.000	100.000		0.000	N
6.42 % Reverse Convertible on Halliburton Rg	USD	1'000.00	30.08.2017	30.08.2018	37 559 985	%	100.740	100.000	100.000		0.000	N
9.59 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.08.2017	30.08.2018	37 559 986	%	100.510	100.000	100.000		0.000	N
4 % Reverse Convertible on Assa Abloy Rg-B	SEK	10'000.00	31.08.2017	31.08.2018	37 560 009	%	98.710	100.000	100.000		0.000	N
10 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	31.08.2017	31.08.2018	37 560 007	%	102.590	100.000	100.000		0.000	N
9.69 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	03.10.2017	03.09.2018	37 560 440	%	97.820	100.000	100.000		0.000	N
9.34 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.10.2017	03.09.2018	37 560 449	%	101.560	100.000	100.000		0.000	N
Lookback Certificate on S&P 500 Index	USD	1'634.96	04.09.2013	04.09.2018	11 863 015	CHF	2530.190	91.550	100.000		0.000	Y
6.07 % Reverse Convertible on Alphabet Rg-A	USD	5'000.00	01.09.2017	04.09.2018	37 560 026	%	100.430	100.000	100.000		0.000	N
6 % Reverse Convertible on Hennes&Mauritz -B-	SEK	10'000.00	04.09.2017	04.09.2018	37 560 037	%	91.770	100.000	100.000		0.000	N
7.5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	01.12.2017	04.09.2018	38 542 621	%	98.180	100.000	100.000		0.000	N
11.2 % Reverse Convertible on Equities 5.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	NOK	10'000.00	05.09.2017	05.09.2018	37 560 044		-	100.000	100.000	05.12.	33.299	N
7.12 % Reverse Convertible on Daimler N 6.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	06.03.2017	06.09.2018	35 119 150		-	100.000	100.000	06.06. 06.09. 06.12.	0.000 0.000 0.000	N
7.12 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.09.2017	06.09.2018	37 560 050	%	98.670	100.000	100.000		0.000	N
7.46 % Reverse Convertible on Equities	CHF	20'000.00	06.09.2017	06.09.2018	37 560 070	%	99.770	100.000	100.000		0.000	N
6.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	06.09.2017	06.09.2018	37 560 069	%	101.940	100.000	100.000		0.000	N
6.97 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.09.2017	06.09.2018	37 560 054	%	98.630	100.000	100.000		0.000	N
4.69 % Reverse Convertible on Rio Tinto Rg	GBP	1'000.00	07.09.2017	07.09.2018	37 560 082	%	99.360	100.000	100.000		0.000	N
1.25 % (5 % p.a) Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	08.09.2016	10.09.2018	32 366 625	%	99.520	100.000	100.000	08.03. 08.06. 08.09. 08.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.03.2017	10.09.2018	35 119 243	%	101.250	97.750	100.000		0.000	Y
7.36 % Reverse Convertible on Vodafone Group Rg	GBP	1'000.00	09.06.2017	10.09.2018	36 828 013	%	99.540	100.000	100.000	11.12.	0.000	N
7 % Reverse Convertible on CS Group N 8.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.09.2017	10.09.2018	37 560 097		-	100.000	100.000	08.12.	0.000	N
6.15 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	11.09.2017	11.09.2018	37 560 104	%	101.160	100.000	100.000		0.000	N
8.2 % Reverse Convertible on Equities 11.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	11.09.2017	11.09.2018	37 560 111		-	100.000	100.000	11.12.	0.000	N
6.56 % Reverse Convertible on ArcelorMittal Rg 11.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	11.09.2017	11.09.2018	37 560 110		-	100.000	100.000	11.12.	0.000	N
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	12.09.2017	12.09.2018	37 560 132	%	98.620	100.000	100.000	12.12.	0.000	N
5.89 % Reverse Convertible on AbbVie Rg	USD	1'000.00	12.09.2017	12.09.2018	37 560 126	%	99.730	100.000	100.000		0.000	N
4 % Reverse Convertible on Adecco Group N	CHF	1'000.00	12.09.2017	12.09.2018	37 560 125	%	99.210	100.000	100.000	12.12.	0.000	N
4 % Reverse Convertible on The Swatch Grp I	CHF	5'000.00	12.09.2017	12.09.2018	37 560 124	%	98.920	100.000	100.000		0.000	N
6.2 % Reverse Convertible on Equities 12.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	12.09.2017	12.09.2018	37 560 051		-	100.000	100.000	12.12.	0.000	N
1.02 % (pro rata) Reverse Convertible on Indices Series NX00183960 13.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	13.09.2016	13.09.2018	12 789 844		-	100.000	100.000	13.03.	0.000	N
8.2 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.09.2017	13.09.2018	37 560 053	%	94.100	100.000	100.000	13.12.	3.407	N
4.25 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.09.2017	13.09.2018	37 560 142	%	98.940	100.000	100.000		0.000	N
8.22 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.09.2017	13.09.2018	37 560 150	%	100.860	100.000	100.000		0.000	N
8.08 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.09.2017	13.09.2018	37 560 158	%	92.630	100.000	100.000	13.12.	3.407	N
8.01 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	21.09.2017	13.09.2018	37 560 263	%	98.410	100.000	100.000		0.000	N
10.2 % Reverse Convertible on Equities 14.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	14.09.2017	14.09.2018	37 560 175		-	100.000	100.000	14.12.	0.000	N
7.28 % Reverse Convertible on Facebook Rg-A 14.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	14.09.2017	14.09.2018	37 560 181		-	100.000	100.000	14.12.	3.410	N
8.02 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.09.2017	14.09.2018	37 560 284	%	98.260	100.000	100.000		0.000	N
12.47 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.09.2017	17.09.2018	37 560 203	%	89.210	100.000	100.000		0.000	N
6.28 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	15.09.2017	17.09.2018	37 560 122	%	101.220	100.000	100.000		0.000	N
6.66 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.11.2017	17.09.2018	38 542 389	%	99.800	100.000	100.000		0.000	N
10.86 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.09.2017	18.09.2018	37 560 216	%	99.380	100.000	100.000		0.000	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4.99 % Reverse Convertible on Barrick Gold Rg	CHF	1'000.00	19.09.2017	19.09.2018	37 560 229	%	89.000	100.000	100.000		0.000	N
7.51 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	20.03.2017	20.09.2018	36 016 144	%	99.820	100.000	100.000		0.000	N
3.7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	20.09.2017	20.09.2018	37 560 243	%	99.820	100.000	100.000		0.000	N
3.09 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.09.2017	20.09.2018	37 560 240	%	99.850	100.000	100.000		0.000	N
9.68 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.09.2017	20.09.2018	37 560 231	%	95.490	100.000	100.000		0.000	N
7.68 % Reverse Convertible on Equities 20.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	20.09.2017	20.09.2018	37 560 232		-	100.000	100.000	20.12.	0.000	N
9.3 % Reverse Convertible on Equities	NOK	10'000.00	21.09.2017	21.09.2018	37 560 261	%	101.570	100.000	100.000		0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	21.09.2017	21.09.2018	37 560 260	%	98.550	100.000	100.000		0.000	N
8.31 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	22.09.2017	24.09.2018	37 560 289	%	98.790	100.000	100.000		0.000	N
8.02 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.09.2017	24.09.2018	37 560 290	%	101.410	100.000	100.000		0.000	N
5.68 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.09.2017	24.09.2018	37 560 296	%	96.820	100.000	100.000		0.000	N
9.83 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	22.09.2017	24.09.2018	37 560 293	%	99.350	100.000	100.000		0.000	N
9.57 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	22.09.2017	24.09.2018	37 560 286	%	98.730	100.000	100.000		0.000	N
European Barrier Autocallable Notes VRN on Euro Stoxx 50 Ix S176136 27.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.466%	EUR	1'000.00	25.09.2015	25.09.2018	12 789 583		-	99.078	99.510		0.000	Y
6.49 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	26.09.2017	26.09.2018	37 560 325	%	99.950	100.000	100.000		0.000	N
10.04 % Reverse Convertible on Equities 27.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	NOK	10'000.00	26.09.2017	26.09.2018	37 560 324		-	100.000	100.000	27.12.	29.948	N
9.36 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.09.2017	26.09.2018	37 560 347	%	99.920	100.000	100.000		0.000	N
7.32 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	27.09.2017	27.09.2018	37 560 363	%	97.120	100.000	100.000		0.000	N
5.42 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.09.2017	27.09.2018	37 560 357	%	95.530	100.000	100.000		0.000	N
10.24 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.09.2017	27.09.2018	37 560 372	%	91.390	100.000	100.000		0.000	N
6.85 % Reverse Convertible on Nike -B-	USD	1'000.00	06.09.2017	28.09.2018	37 560 028	%	100.710	100.000	100.000		0.000	N
8 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.09.2017	28.09.2018	37 560 395	%	97.030	100.000	100.000		0.000	N
5.73 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.09.2017	28.09.2018	37 560 393	%	96.400	100.000	100.000		0.000	N
7.08 % Reverse Convertible on UniCredit N	EUR	1'000.00	29.09.2017	01.10.2018	37 560 405	%	94.250	100.000	100.000	29.12.	0.000	N
9.49 % Reverse Convertible on Equities	USD	10'000.00	29.09.2017	01.10.2018	37 560 412	%	96.620	100.000	100.000		0.000	N
6.76 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.09.2017	01.10.2018	37 560 408	%	99.250	100.000	100.000	29.12.	0.000	N
11.14 % Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	03.10.2017	03.10.2018	37 560 457	%	100.670	100.000	100.000		0.000	N
5.87 % Reverse Convertible on Walt Disney Rg-Dis	USD	1'000.00	03.10.2017	03.10.2018	37 560 460	%	98.630	100.000	100.000		0.000	N
8.01 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.10.2017	04.10.2018	37 560 502	%	98.800	100.000	100.000		0.000	N
8.04 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.10.2017	04.10.2018	37 560 487	%	99.570	100.000	100.000		0.000	N
7.99 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.10.2017	04.10.2018	37 560 498	%	99.690	100.000	100.000		0.000	N
5.8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.10.2017	04.10.2018	37 560 495	%	99.620	100.000	100.000		0.000	N
5.52 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	04.10.2017	04.10.2018	37 560 490	%	99.330	100.000	100.000		0.000	N
7.08 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.10.2017	04.10.2018	37 560 492	%	97.600	100.000	100.000		0.000	N
9.12 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.10.2017	04.10.2018	37 560 486	%	92.950	100.000	100.000		0.000	N
8.18 % Reverse Convertible on Rio Tinto Rg	GBP	1'000.00	04.12.2017	04.10.2018	38 542 626	%	100.930	100.000	100.000		0.000	N
10.37 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	05.04.2017	05.10.2018	36 016 423	%	102.630	100.000	100.000		0.000	N
4.92 % Reverse Convertible on Clariant N	CHF	1'000.00	05.10.2017	05.10.2018	37 560 507	%	99.550	100.000	100.000		0.000	N
10.24 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	05.10.2017	05.10.2018	37 560 516	%	94.830	100.000	100.000			N
10.68 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.10.2017	05.10.2018	37 560 515	%	94.960	100.000	100.000		0.000	N
9 % Reverse Convertible on Equities 6.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.07.2017	08.10.2018	36 828 437		-	100.000	100.000		0.000	N
8.19 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.10.2017	08.10.2018	37 560 475	%	101.340	100.000	100.000		0.000	N
8.38 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	06.10.2017	08.10.2018	37 560 537	%	100.500	100.000	100.000		0.000	N
6.36 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.10.2017	08.10.2018	37 560 488	%	99.750	100.000	100.000		0.000	N
7.34 % Reverse Convertible on Equities	CHF	20'000.00	06.10.2017	08.10.2018	37 560 548	%	101.270	100.000	100.000		0.000	N
3.82 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.04.2017	10.10.2018	36 016 470	%	100.710	100.000	100.000		0.000	N
8 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.10.2017	10.10.2018	37 560 568	%	98.390	100.000	100.000		0.000	N
10 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	10.10.2017	10.10.2018	37 560 572	%	102.290	100.000	100.000		0.000	N
10.06 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.10.2017	10.10.2018	37 560 566	%	99.770	100.000	100.000		0.000	N
5.54 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.10.2017	10.10.2018	37 560 564	%	98.310	100.000	100.000		0.000	N
5.64 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.04.2017	11.10.2018	36 016 507	%	100.630	100.000	100.000	11.07. 11.10.	3.510 3.525	N
8.96 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.10.2017	11.10.2018	38 541 795	%	99.060	100.000	100.000		0.000	N
13.17 % Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	11.10.2017	11.10.2018	37 560 583	%	95.550	100.000	100.000		0.000	N
8.56 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.10.2017	11.10.2018	38 541 794	%	96.940	100.000	100.000		0.000	N
3 % Reverse Convertible on AB InBev	EUR	1'000.00	11.10.2017	11.10.2018	38 541 810	%	94.050	100.000	100.000		0.000	N
7.18 % Reverse Convertible on ING Group Rg	EUR	1'000.00	18.07.2017	12.10.2018	36 828 623	%	100.460	100.000	100.000		0.000	N
5.99 % Reverse Convertible on Airbus Br	EUR	1'000.00	18.07.2017	12.10.2018	36 828 624	%	100.570	100.000	100.000		0.000	N
4.92 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	12.10.2017	12.10.2018	38 541 809	%	97.340	100.000	100.000		0.000	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
7.8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	12.10.2017	12.10.2018	38 541 817	%	96.830	100.000	100.000		0.000	N
7.77 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.10.2017	15.10.2018	38 541 834	%	94.620	100.000	100.000		0.000	N
8.16 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.10.2017	16.10.2018	38 541 871	%	99.070	100.000	100.000		0.000	N
7.64 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	16.10.2017	16.10.2018	38 541 872	%	98.460	100.000	100.000		0.000	N
8.4 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.10.2017	16.10.2018	37 560 563	%	100.640	100.000	100.000		0.000	N
7.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	16.10.2017	16.10.2018	38 541 869	%	99.980	100.000	100.000		0.000	N
10.64 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.10.2017	17.10.2018	38 541 881	%	100.030	100.000	100.000		0.000	N
13.72 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.10.2017	17.10.2018	38 541 880	%	86.100	100.000	100.000		0.000	N
12.68 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.10.2017	17.10.2018	38 541 878	%	101.680	100.000	100.000		0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.10.2017	17.10.2018	38 541 873	%	98.190	100.000	100.000		0.000	N
6 % Reverse Convertible on Statoil Rg	NOK	10'000.00	18.10.2017	18.10.2018	38 541 917	%	101.670	100.000	100.000		0.000	N
6.46 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.10.2017	18.10.2018	38 541 933	%	99.620	100.000	100.000		0.000	N
6.28 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.10.2016	19.10.2018	34 015 324	%	97.240	100.000	100.000	20.07. 20.10.	17.376 18.200	N
3 % Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	19.04.2017	19.10.2018	36 016 587	%	99.450	100.000	100.000		0.000	N
8.72 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	19.10.2017	19.10.2018	38 541 951	%	99.640	100.000	100.000		0.000	N
8.56 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.10.2017	19.10.2018	38 541 954	%	99.870	100.000	100.000		0.000	N
6.04 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	19.10.2017	19.10.2018	38 541 937	%	98.790	100.000	100.000		0.000	N
7.52 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.10.2017	19.10.2018	38 541 946	%	97.300	100.000	100.000		0.000	N
6.49 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.10.2017	19.10.2018	38 541 941	%	99.260	100.000	100.000		0.000	N
5.88 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	19.10.2017	19.10.2018	38 541 936	%	98.120	100.000	100.000		0.000	N
5.82 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	20.04.2017	22.10.2018	36 016 609	%	102.150	100.000	100.000		0.000	N
7.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	20.10.2017	22.10.2018	38 541 956	%	99.730	100.000	100.000	20.11. 20.12.	0.000 0.000	N
9.36 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	20.10.2017	22.10.2018	38 541 958	%	100.230	100.000	100.000		0.000	N
12.44 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.10.2017	22.10.2018	38 541 966	%	101.400	100.000	100.000		0.000	N
9.44 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.10.2017	22.10.2018	38 541 974	%	97.300	100.000	100.000		0.000	N
9.48 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.10.2017	22.10.2018	38 541 975	%	97.320	100.000	100.000		0.000	N
8.6 % Reverse Convertible on Equities	EUR	5'000.00	20.10.2017	22.10.2018	38 541 973	%	97.590	100.000	100.000		0.000	N
8.67 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	23.11.2017	23.10.2018	38 542 494	%	100.050	100.000	100.000		0.000	N
3.96 % Reverse Convertible on Roche Hldg G	CHF	5'000.00	25.04.2017	25.10.2018	36 016 678	%	97.040	100.000	100.000	25.10.	0.000	N
10.52 % Reverse Convertible on Equities 25.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	25.04.2017	25.10.2018	36 016 683		-	100.000	100.000	25.10.	0.000	N
5.56 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.10.2017	29.10.2018	38 542 084	%	98.420	100.000	100.000		0.000	N
10 % Reverse Convertible on Equities	USD	10'000.00	27.10.2017	29.10.2018	38 542 103	%	94.380	100.000	100.000		0.000	N
8 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.10.2017	29.10.2018	38 542 095	%	98.860	100.000	100.000		0.000	N
6.4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.10.2017	29.10.2018	38 542 082	%	98.330	100.000	100.000		0.000	N
3.5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.10.2017	30.10.2018	38 542 108	%	95.940	100.000	100.000		0.000	N
9 % Reverse Convertible on MGM Resorts Itl Rg	USD	1'000.00	30.10.2017	30.10.2018	38 542 115	%	99.320	100.000	100.000		0.000	N
7.48 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	31.10.2017	31.10.2018	38 542 154	%	97.580	100.000	100.000		0.000	N
6.9 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.10.2017	31.10.2018	38 542 164	%	97.240	100.000	100.000		0.000	N
6.52 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	31.10.2017	31.10.2018	38 542 174	%	97.130	100.000	100.000		0.000	N
3.74 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	31.10.2017	31.10.2018	38 542 135	%	97.370	100.000	100.000		0.000	N
9.4 % Reverse Convertible on Freeport McMoRan Rg	USD	1'000.00	31.10.2017	31.10.2018	38 542 153	%	99.800	100.000	100.000		0.000	N
6 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	01.11.2017	01.11.2018	38 542 166	%	99.480	100.000	100.000		0.000	N
4.04 % Reverse Convertible on FTSE 100	GBP	1'000.00	02.11.2017	02.11.2018	38 542 178	%	99.050	100.000	100.000		0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	02.11.2017	02.11.2018	38 542 181	%	96.610	100.000	100.000		0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	02.11.2017	02.11.2018	38 542 182	%	98.520	100.000	100.000		0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	02.11.2017	02.11.2018	38 542 179	%	96.670	100.000	100.000		0.000	N
3 % Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	03.05.2017	05.11.2018	36 016 745	%	98.420	100.000	100.000		0.000	N
5.59 % Reverse Convertible on Hennes&Mauritz -B-	SEK	10'000.00	04.07.2017	05.11.2018	36 828 384	%	92.350	100.000	100.000		0.000	N
6.34 % Reverse Convertible on Walt Disney Rg-Dis	USD	1'000.00	03.11.2017	05.11.2018	38 542 200	%	99.360	100.000	100.000		0.000	N
7.24 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.11.2017	05.11.2018	38 542 196	%	99.950	100.000	100.000		0.000	N
8.62 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	03.11.2017	05.11.2018	38 542 197	%	96.710	100.000	100.000		0.000	N
6.29 % Reverse Convertible on Equities 8.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.05.2017	08.11.2018	36 016 808		-	100.000	100.000	10.07. 10.09. 10.11.	0.000 0.000 0.000	N
4 % Reverse Convertible on Indices 8.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	GBP	1'000.00	08.05.2017	08.11.2018	36 016 742		-	100.000	100.000	08.08. 08.11.	0.000 0.000	N
7.04 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.05.2017	08.11.2018	36 016 806	%	102.190	100.000	100.000		0.000	N
7.05 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.05.2017	08.11.2018	36 016 807	%	102.180	100.000	100.000		0.000	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
8.73 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.11.2017	08.11.2018	38 542 266	%	94.250	100.000	100.000		0.000	N
5.57 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.11.2017	08.11.2018	38 542 264	%	96.060	100.000	100.000		0.000	N
6.8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	09.11.2017	09.11.2018	38 542 277	%	97.140	100.000	100.000		0.000	N
15.08 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	09.11.2017	09.11.2018	38 542 299	%	98.010	100.000	100.000		0.000	N
13.94 % Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	09.11.2017	09.11.2018	38 542 296	%	99.030	100.000	100.000		0.000	N
11.22 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.05.2017	12.11.2018	36 016 792		-	100.000	100.000	10.07. 11.09.	0.000 0.000	N
10.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
6.59 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.05.2017	12.11.2018	36 016 798		-	100.000	100.000	10.07. 10.09. 10.11.	0.000 0.000 0.000	N
10.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
8.44 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.05.2017	12.11.2018	36 016 837		-	100.000	100.000	10.08.	0.000	N
10.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
8.4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.05.2017	12.11.2018	36 016 839		-	100.000	100.000	10.08. 10.11.	0.000 0.000	N
10.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
4.79 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	11.05.2017	12.11.2018	36 016 858		-	100.000	100.000	11.07.	0.000	N
11.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
6.29 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.05.2017	12.11.2018	36 016 859		-	100.000	100.000		0.000	N
11.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
8.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.05.2017	12.11.2018	36 016 849		-	100.000	100.000	11.08. 13.11.	20.500 20.500	N
13.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
8.28 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.05.2017	12.11.2018	36 016 872		-	100.000	100.000		0.000	N
13.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
5.33 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	11.05.2017	12.11.2018	36 016 857	%	98.940	100.000	100.000	11.07. 11.09. 13.11.	0.000 0.000 0.000	N
6.86 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	12.05.2017	12.11.2018	36 016 897	%	100.620	100.000	100.000		0.000	N
5.38 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	10.11.2017	12.11.2018	38 542 302	%	99.120	100.000	100.000		0.000	N
6.92 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.11.2017	14.11.2018	38 542 369	%	99.230	100.000	100.000		0.000	N
10.32 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.05.2017	15.11.2018	36 016 912	%	97.140	100.000	100.000	15.08. 15.11.	0.000 0.000	N
8.35 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.05.2017	15.11.2018	36 016 909	%	101.140	100.000	100.000		0.000	N
5.45 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.05.2017	15.11.2018	36 016 908	%	94.910	100.000	100.000	17.07. 15.09. 15.11.	0.000 0.000 0.000	N
6.8 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.11.2017	15.11.2018	38 542 390	%	98.790	100.000	100.000		0.000	N
6.92 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.11.2017	15.11.2018	38 542 391	%	99.810	100.000	100.000		0.000	N
7.92 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.11.2017	15.11.2018	38 542 379	%	96.200	100.000	100.000		0.000	N
Protect-Anl. on basket	USD	1'000.00	16.11.2012	16.11.2018	20 024 184	%	143.700	94.383	100.000		0.000	Y
10.2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.05.2017	16.11.2018	36 016 932	%	97.630	100.000	100.000	17.07. 17.09. 17.11.	0.000 0.000 0.000	N
8.04 % Reverse Convertible on Equities	CHF	20'000.00	21.06.2017	16.11.2018	36 828 180	%	101.960	100.000	100.000		0.000	N
11 % Reverse Convertible on Equities	USD	10'000.00	16.11.2017	16.11.2018	38 542 413	%	98.320	100.000	100.000		0.000	N
5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.11.2017	16.11.2018	38 542 420	%	98.900	100.000	100.000		0.000	N
5.11 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	16.11.2017	16.11.2018	38 542 397	%	100.230	100.000	100.000		0.000	N
8.51 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.05.2017	19.11.2018	36 016 998	%	99.690	100.000	100.000	18.07. 18.09. 20.11.	0.000 0.000 0.000	N
6.62 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	19.05.2017	19.11.2018	36 017 021	%	101.060	100.000	100.000		0.000	N
3.8 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.11.2017	21.11.2018	38 542 458	%	99.790	100.000	100.000		0.000	N
11.44 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	22.11.2017	22.11.2018	38 542 473	%	97.880	100.000	100.000		0.000	N
6.08 % Reverse Convertible on CieFinRichemont N	CHF	1'000.00	23.11.2017	23.11.2018	38 542 493	%	98.820	100.000	100.000		0.000	N
6.79 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.11.2017	23.11.2018	38 542 491	%	98.250	100.000	100.000		0.000	N
9.06 % Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	24.11.2017	26.11.2018	38 542 514	%	96.600	100.000	100.000		0.000	N
7.58 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.11.2017	29.11.2018	38 542 581	%	98.970	100.000	100.000		0.000	N
6.64 % Reverse Convertible on Equities	USD	10'000.00	29.11.2017	29.11.2018	38 542 459	%	98.550	100.000	100.000		0.000	N
11.44 % Reverse Convertible on Equities	USD	10'000.00	29.11.2017	29.11.2018	38 542 460	%	98.830	100.000	100.000		0.000	N
1.25 % (5 % p.a.) Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	30.11.2016	30.11.2018	12 789 956	%	99.540	100.000	100.000	28.02. 31.05. 31.08. 30.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
11.75 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.11.2017	30.11.2018	38 542 602	%	97.150	100.000	100.000		0.000	N
4.36 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	07.02.2017	03.12.2018	35 118 820	%	102.720	100.000	100.000		0.000	N
9.52 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.09.2017	04.12.2018	37 560 035	%	94.400	100.000	100.000		0.000	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
7.01 % Reverse Convertible on BNP Paribas-A-	EUR	1'000.00	06.06.2017	06.12.2018	36 827 901	%	99.100	100.000	100.000		0.000	N
11.08 % Reverse Convertible on Equities	NOK	10'000.00	06.12.2017	06.12.2018	38 542 670	%	98.660	100.000	100.000		0.000	N
5.86 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.12.2016	07.12.2018	34 015 925	%	104.130	100.000	100.000	08.12.	0.100	N
5.95 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	08.12.2016	07.12.2018	34 015 924	%	104.190	100.000	100.000	08.12.	0.500	N
12.28 % Reverse Convertible on Equities 7.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.06.2017	07.12.2018	36 827 921		-	100.000	100.000	 07.09.	 0.000	N
6.97 % Reverse Convertible on Infineon Technolo N	EUR	1'000.00	10.07.2017	07.12.2018	36 828 481	%	103.600	100.000	100.000		0.000	N
5.84 % Reverse Convertible on Eni N	EUR	1'000.00	10.07.2017	07.12.2018	36 828 484	%	102.050	100.000	100.000		0.000	N
4 % Reverse Convertible on CS Group N	CHF	1'000.00	09.10.2017	10.12.2018	37 560 559	%	99.730	100.000	100.000	11.12.	0.000	N
Index Linked Note on BC ARMOUR CHF 7 %ER-Index	CHF	1'000.00	13.12.2010	13.12.2018	11 862 143	%	114.840	97.200	112.000		0.000	Y
8.5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.06.2017	13.12.2018	36 828 294	%	97.900	100.000	100.000		0.000	N
7.3 % Reverse Convertible on Marks & Spencer Rg	GBP	1'000.00	16.11.2017	14.12.2018	38 542 394	%	100.050	100.000	100.000		0.000	N
6.29 % Reverse Convertible on Lvmh	EUR	1'000.00	17.07.2017	17.12.2018	36 828 604	%	102.840	100.000	100.000		0.000	N
5.83 % Reverse Convertible on Valeo	EUR	1'000.00	17.07.2017	17.12.2018	36 828 605	%	98.500	100.000	100.000		0.000	N
5.06 % Reverse Convertible on adidas N	EUR	1'000.00	17.07.2017	17.12.2018	36 828 603	%	97.690	100.000	100.000		0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.12.2016	20.12.2018	34 016 047	%	63.910	97.280	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	22.12.2016	21.12.2018	34 016 062	%	102.450	100.000	100.000	22.12.	0.500	N
3 % Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 23.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	23.12.2016	21.12.2018	34 016 089		-	100.000	100.000	23.03.	0.000	N
5.15 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	23.12.2016	21.12.2018	34 016 083	%	102.630	100.000	100.000	27.12.	0.50547	N
Capital Protected-Notes on Backwardation Alpha VOLT	EUR	1'000.00	23.12.2013	24.12.2018	11 863 104	%	109.480	92.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.07.2017	07.01.2019	36 828 450	%	106.340	97.765	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.07.2017	07.01.2019	36 828 449	%	113.760	95.605	97.790		0.000	Y
5.29 % Reverse Convertible on AB InBev	EUR	1'000.00	08.02.2017	15.01.2019	35 118 836	%	99.710	100.000	100.000		0.000	N
10.52 % Reverse Convertible on Equities 17.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	17.01.2017	17.01.2019	35 118 497		-	100.000	100.000	17.07.	0.000	N
6.22 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.01.2017	18.01.2019	35 118 521	%	102.590	100.000	100.000	18.07.	0.000	N
8.12 % Reverse Convertible on Equities 23.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	23.01.2017	23.01.2019	35 118 589		-	100.000	100.000	24.07. 23.10.	0.000 0.000	N
5.67 % Reverse Convertible on UBS Group N	CHF	1'000.00	24.01.2017	24.01.2019	35 118 605	%	102.390	100.000	100.000		0.000	N
9.92 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	24.07.2017	24.01.2019	36 828 715	%	100.430	100.000	100.000	24.10.	0.000	N
9.88 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	24.07.2017	24.01.2019	36 828 714	%	98.160	100.000	100.000		0.000	N
8.36 % Reverse Convertible on Equities 26.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	26.01.2017	25.01.2019	35 118 658		-	100.000	100.000	26.07.	0.000	N
4.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	25.07.2017	25.01.2019	37 559 588	%	99.500	100.000	100.000		0.000	N
7.04 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.02.2017	01.02.2019	35 118 779	%	98.970	100.000	100.000	03.05. 03.08. 03.11.	3.590 3.507 17.604	N
Lookback Certificate on S&P 500 Index	USD	1'842.10	07.02.2014	07.02.2019	22 905 905	CHF	2566.090	92.250	100.000		0.000	Y
7.46 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.08.2017	07.02.2019	37 559 743	%	97.170	100.000	100.000		0.000	N
11.63 % Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	10.08.2017	11.02.2019	37 559 790	%	102.630	100.000	100.000		0.000	N
2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	14.09.2017	14.02.2019	37 560 166	%	100.740	100.000	100.000		0.000	N
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	29.08.2017	01.03.2019	26 829 543	%	99.900	97.804	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.03.2017	04.03.2019	35 119 155	%	103.110	96.267	100.000	02.06. 05.09. 02.12.	0.000 0.000 0.000	Y
4.62 % Reverse Convertible on ESTXBnk EUR P	CHF	1'000.00	11.09.2017	11.03.2019	37 560 108	%	99.060	100.000	100.000		0.000	N
11.72 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	12.09.2017	12.03.2019	37 560 128	%	98.180	100.000	100.000	12.12.	0.000	N
Autocallable Notes on Basket	GBP	1'000.00	14.03.2013	14.03.2019	10 436 821	%	101.370	91.610	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 15.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	15.03.2017	15.03.2019	35 119 330		-	100.000	100.000	15.06. 15.09.	0.000 0.000	N
Lookback Certificate on S&P 500 Index	USD	1'877.17	17.03.2014	18.03.2019	22 905 946	CHF	2564.250	91.820	100.000		0.000	Y
6.89 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.05.2017	18.03.2019	36 016 997	%	98.760	100.000	100.000	18.07. 18.09. 20.11.	0.000 0.000 0.000	N
6.83 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.05.2017	18.03.2019	36 016 996	%	98.680	100.000	100.000	18.07. 18.09. 20.11.	0.000 0.000 0.000	N
6.02 % Reverse Convertible on Siemens N	EUR	1'000.00	10.07.2017	20.03.2019	36 828 482	%	96.900	100.000	100.000		0.000	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.49 % Reverse Convertible on Infineon Technolo N	CHF	1'000.00	21.09.2017	21.03.2019	37 560 271	%	101.190	100.000	100.000		0.000	N
4.96 % Reverse Convertible on Indices 23.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	23.09.2016	22.03.2019	29 018 922		-	100.000	100.000		0.000	N
Lookback Certificate on S&P 500 Index	USD	1'852.56	31.03.2014	01.04.2019	22 905 971	CHF	2533.740	91.550	100.000		0.000	Y
9.84 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.10.2017	02.04.2019	37 560 430	%	97.350	100.000	100.000		0.000	N
14.04 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.10.2017	03.04.2019	37 560 461	%	94.210	100.000	100.000		0.000	N
9.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.10.2017	03.04.2019	37 560 462	%	99.680	100.000	100.000		0.000	N
4.64 % Reverse Convertible on Indices 11.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	11.04.2017	11.04.2019	36 016 505		-	100.000	100.000	11.07.	3.873	N
Reverse Convertible on Equities 26.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.643%	USD	1'000.00	26.04.2017	26.04.2019	36 016 651		-	97.010	100.000		0.000	Y
6.53 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.11.2017	09.05.2019	38 542 295	%	96.230	100.000	100.000		0.000	N
Lookback Certificate on S&P 500 Index	USD	1'880.47	16.05.2014	16.05.2019	22 906 010	CHF	2515.330	91.820	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	17.05.2017	17.05.2019	36 016 966	%	97.880	100.000	100.000	17.11.	0.00583	N
2 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	24.05.2017	24.05.2019	36 017 089	%	97.980	100.000	100.000	24.07. 25.09. 24.11.	0.000 0.000 0.000	N
4 % Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	24.05.2017	24.05.2019	36 017 088	%	97.410	100.000	100.000	24.07. 25.09. 24.11.	0.000 0.000 7.790	N
Autocall Barrier Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	28.05.2014	28.05.2019	22 906 030	%	99.770	92.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 27.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.858%	USD	1'000.00	26.05.2017	28.05.2019	36 827 777		-	97.000	100.000		0.000	Y
2.4 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	31.05.2017	31.05.2019	36 827 773	%	98.150	100.000	100.000	31.08. 30.11.	0.000 0.000	N
4.2 % Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	01.06.2017	31.05.2019	36 827 815	%	97.580	100.000	100.000		0.000	N
Lookback Certificate on S&P 500 Index	USD	1'909.78	04.06.2014	04.06.2019	22 906 023	CHF	2549.860	92.340	100.000		0.000	Y
2.68 % Reverse Convertible on SMI	CHF	1'000.00	06.12.2017	06.06.2019	38 542 682	%	97.670	100.000	100.000		0.000	N
5.19 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.06.2017	11.06.2019	36 828 016	%	101.870	100.000	100.000		0.000	N
5.03 % Reverse Convertible on Equities 18.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	16.06.2017	14.06.2019	36 828 123		-	100.000	100.000	16.08. 16.10. 16.12.	0.000 0.000 0.000	N
6.15 % Reverse Convertible on AXA	EUR	1'000.00	20.10.2017	14.06.2019	38 541 964	%	96.860	100.000	100.000		0.000	N
10.68 % Reverse Convertible on Equities 20.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	20.06.2017	20.06.2019	36 828 167		-	100.000	100.000	20.09.	0.000	N
8.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.06.2017	20.06.2019	36 828 169	%	103.250	100.000	100.000		0.000	N
Lookback Certificate on S&P 500 Index	USD	1'924.24	26.06.2014	26.06.2019	22 906 034	CHF	2581.320	91.570	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	28.06.2017	28.06.2019	36 828 286	%	97.990	100.000	100.000		0.000	N
6.68 % Reverse Convertible on Lvmh 29.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	29.06.2017	28.06.2019	36 828 363		-	100.000	100.000	29.09. 29.12.	0.000 0.000	N
4.64 % Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 29.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	29.06.2017	28.06.2019	36 828 335		-	100.000	100.000	29.09. 29.12.	0.000 0.000	N
8.06 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.07.2017	12.07.2019	36 828 538	%	100.200	100.000	100.000		0.000	N
4.79 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.07.2017	12.07.2019	36 828 537	%	102.320	100.000	100.000		0.000	N
6.41 % Reverse Convertible on Airbus Br	EUR	1'000.00	20.10.2017	12.07.2019	38 541 963	%	98.640	100.000	100.000		0.000	N
6.23 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.11.2017	16.07.2019	38 542 395	%	97.390	100.000	100.000		0.000	N
6.59 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.11.2017	16.07.2019	38 542 415	%	98.220	100.000	100.000		0.000	N
5.44 % Reverse Convertible on Equities 23.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	21.07.2017	19.07.2019	36 828 692		-	100.000	100.000		0.000	N
6.95 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.11.2017	22.07.2019	38 542 484	%	97.860	100.000	100.000		0.000	N
Lookback Certificate 2014-01.8.19 on S&P 500 Index	USD	1'978.34	01.08.2014	01.08.2019	22 906 047	CHF	2602.950	91.380	100.000		0.000	Y
5.32 % Reverse Convertible on Equities	CHF	20'000.00	03.08.2017	02.08.2019	37 559 698	%	103.710	100.000	100.000		0.000	N
5.01 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.08.2017	02.08.2019	37 559 696	%	95.780	100.000	100.000		0.000	N
4.57 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.08.2017	02.08.2019	37 559 697	%	100.910	100.000	100.000		0.000	N
6.53 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	01.12.2017	02.08.2019	38 542 609	%	97.020	100.000	100.000		0.000	N
Lookback Certificate on S&P 500 Index	USD	1'969.95	05.08.2014	05.08.2019	22 906 060	CHF	2639.300	91.320	100.000		0.000	Y
Capital Protected Note on Barclays Capital ERA ER-Index	NOK	10'000.00	08.08.2011	08.08.2019	11 862 372	%	142.310	101.963	141.000		0.000	Y
4.76 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.08.2017	09.08.2019	37 559 744	%	96.170	100.000	100.000		0.000	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.81 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	23.08.2017	23.08.2019	37 559 893	%	97.220	100.000	100.000	23.10. 27.12.	0.000 0.000	N
6.12 % Reverse Convertible on CS Group N	CHF	1'000.00	06.09.2017	30.08.2019	37 560 068	%	104.540	100.000	100.000		0.000	N
4 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	31.08.2016	02.09.2019	26 829 363	%	102.540	100.000	100.000	31.08.	0.000	N
5 % Reverse Convertible on Equities 5.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	05.09.2017	05.09.2019	37 560 045		-	100.000	100.000		0.000	N
Lookback Certificate on S&P 500 Index	USD	1'978.91	09.09.2014	09.09.2019	22 906 058	CHF	2577.120	91.380	100.000		0.000	Y
7.4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.09.2017	13.09.2019	37 560 185	%	98.710	100.000	100.000	15.12.	0.000	N
European Barrier Autocallable Notes VRN on Banco Bilbao Vizcaya Shs	EUR	1'000.00	25.09.2015	25.09.2019	12 789 585	%	98.580	97.917	98.920		0.000	Y
11.56 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.09.2017	26.09.2019	37 560 333	%	98.460	100.000	100.000		0.000	N
9.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	28.09.2017	27.09.2019	37 560 375	%	92.440	100.000	100.000		0.000	N
7.01 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	29.09.2017	27.09.2019	37 560 406	%	99.740	100.000	100.000		0.000	N
5.54 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	29.09.2017	27.09.2019	37 560 410	%	99.160	100.000	100.000		0.000	N
5.53 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	29.09.2017	27.09.2019	37 560 409	%	99.170	100.000	100.000		0.000	N
Principal Protected Note on Indices-Basket	USD	1'000.00	29.09.2014	30.09.2019	22 906 101	%	108.870	88.480	97.500		0.000	Y
Lookback Certificate on S&P 500 Index	USD	1'982.77	30.09.2014	30.09.2019	22 906 094	CHF	2583.600	90.915	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.10.2017	03.10.2019	37 560 467	%	102.600	96.662	100.000		0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.10.2017	03.10.2019	37 560 469	%	101.780	96.662	100.000		0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.10.2017	03.10.2019	37 560 466	%	101.270	96.662	100.000		0.000	Y
5.32 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	12.10.2017	11.10.2019	38 541 819	%	98.570	100.000	100.000		0.000	N
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	14.04.2017	14.10.2019	26 829 443	%	98.710	91.794	95.770		0.000	Y
Capital Protected Note on SMI-Index	CHF	1'000.00	28.10.2014	28.10.2019	22 906 127	%	103.100	93.960	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	26.10.2016	28.10.2019	26 829 380	CHF	1107.400	100.000	100.000		0.000	Y
Lookback Certificate on S&P 500 Index	USD	1'964.82	31.10.2014	31.10.2019	22 906 120	CHF	2485.770	91.900	100.000		0.000	Y
7.16 % Reverse Convertible on Societe Generale	EUR	1'000.00	06.11.2017	06.11.2019	38 542 214	%	92.230	100.000	100.000		0.000	N
Reverse Convertible on FTSE MIB	EUR	1'000.00	16.11.2016	18.11.2019	26 829 383	%	101.510	99.970	99.970		0.000	Y
3.2 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	20.11.2017	20.11.2019	38 542 446	%	97.350	100.000	100.000		0.000	N
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	30.05.2017	29.11.2019	26 829 467	%	97.320	95.970	100.000		0.000	Y
6.1 % Reverse Convertible on Netflix Rg	CHF	1'000.00	30.11.2017	29.11.2019	38 542 597	%	97.800	100.000	100.000		0.000	N
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	31.05.2017	02.12.2019	26 829 485	%	97.290	96.112	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	02.06.2017	03.12.2019	26 829 486	%	98.060	96.056	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	08.06.2017	09.12.2019	26 829 489	%	97.070	96.114	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	09.06.2017	09.12.2019	26 829 490	%	97.610	96.138	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	19.06.2017	19.12.2019	26 829 483	%	97.240	96.046	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Euro Stoxx 50	USD	1'000.00	19.06.2017	19.12.2019	26 829 495	%	96.120	96.046	100.000		0.000	Y
Notes on Barc ARMOUR 7% CHF-Index	AUD	1'000.00	29.12.2010	27.12.2019	11 862 172	%	156.170	98.690	168.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	30.11.2017	28.02.2020	38 542 594	%	97.130	100.000	100.000		0.000	N
4.64 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	17.03.2017	16.03.2020	36 016 127	%	98.910	100.000	100.000	19.06. 19.09. 19.12.	0.000 0.000 0.000	N
Lookback Certificate on S&P 500-Index	USD	2'073.29	08.04.2015	08.04.2020	26 829 217	CHF	2617.910	92.590	100.000		0.000	Y
European Barrier Autocallable Notes VRN on IBEX 35 Ix Series NX00169338	EUR	1'000.00	10.04.2015	14.04.2020	13 046 452	%	95.270	98.670	100.000		0.000	Y
4.2 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	11.05.2017	08.05.2020	36 016 871	%	97.440	100.000	100.000	11.08. 13.11.	0.000 0.000	N
5.12 % Reverse Convertible on Indices 13.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	12.05.2017	11.05.2020	36 016 901		-	100.000	100.000	14.08. 13.11.	0.000 0.000	N
European Barrier Autocallable Notes VRN on Euro Stoxx 50 Ix S170730 17.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.212%	EUR	1'000.00	15.05.2015	15.05.2020	13 046 515		-	98.140	100.000		0.000	Y
Autocallable Notes VRN on Euro Stoxx 50 Index S171663	EUR	1'000.00	02.06.2015	02.06.2020	13 046 538	%	99.250	98.030	100.000		0.000	Y
European Barrier Autocallable Notes VRN on Banco Bilbao Vizcaya	EUR	1'000.00	04.06.2015	04.06.2020	13 046 543	%	84.130	98.180	100.000		0.000	Y
5.52 % Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	20.06.2017	19.06.2020	36 828 164		-	100.000	100.000	20.09.	3.486	N
5.04 % Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	12.07.2017	10.07.2020	36 828 524	%	99.420	100.000	100.000	12.10.	12.300	N
Protection Participation on S&P 500	USD	1'000.00	17.07.2017	17.07.2020	26 829 512	%	99.050	94.813	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	19.07.2017	20.07.2020	26 829 507	%	97.650	94.964	100.000		0.000	Y
European Barrier Autocallable Notes VRN on Euro Stoxx 50 IxS174015	EUR	1'000.00	21.07.2015	21.07.2020	12 791 529	%	101.890	97.480	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	26.07.2017	27.07.2020	26 829 522	%	98.370	90.317	95.050		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	26.07.2017	27.07.2020	26 829 509	%	96.260	90.317	95.050		0.000	Y
Note on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	30.07.2014	30.07.2020	22 906 046	%	103.180	88.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	09.08.2017	10.08.2020	37 559 791	CHF	1023.000	95.079	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	10.08.2017	10.08.2020	26 829 518	%	96.960	95.079	100.000		0.000	Y
5.12 % Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	30.08.2017	28.08.2020	37 559 961	%	98.510	100.000	100.000	30.11.	3.878	N
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	31.08.2017	28.08.2020	26 829 535	%	96.580	95.144	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	31.08.2017	28.08.2020	26 829 545	%	96.620	95.124	100.000		0.000	Y
4.58 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.09.2017	10.09.2020	37 560 109	%	98.840	100.000	100.000		0.000	N
European Barrier Autocallable Notes VRN on Euro Stoxx 50 Index S175799 13.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.73%	EUR	1'000.00	11.09.2015	11.09.2020	12 789 576		-	98.122	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	22.09.2017	22.09.2020	26 829 546	%	98.100	94.956	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	2'348.45	29.03.2017	29.09.2020	26 829 445	CHF	2474.650	87.835	93.720		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500 Index	USD	2'135.09	30.09.2016	30.09.2020	26 829 374	CHF	2513.290	95.430	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	CAD	1'000.00	10.10.2017	12.10.2020	26 829 564	%	96.700	94.207	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	13.10.2017	13.10.2020	26 829 556	%	97.020	94.560	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500 Series 3450	USD	2'355.54	14.04.2017	14.10.2020	26 829 442	CHF	2467.840	93.738	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500 Index	USD	2'175.00	20.10.2016	20.10.2020	26 829 378	CHF	2470.900	95.299	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	25.10.2017	26.10.2020	26 829 563	CHF	1107.860	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Apple	USD	1'000.00	26.10.2017	26.10.2020	26 829 566	%	96.840	94.523	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	24.05.2017	24.11.2020	26 829 479	%	103.950	94.329	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SX5E Index	EUR	1'000.00	26.05.2017	26.11.2020	26 829 480	%	98.760	99.889	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	29.11.2017	30.11.2020	26 829 586	%	97.710	94.223	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	12.12.2017	14.12.2020	26 829 592	%	98.110	93.972	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	2'270.76	03.01.2017	04.01.2021	26 829 400	CHF	2442.050	92.736	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Euro Stoxx 50	EUR	1'000.00	07.07.2017	06.01.2021	26 829 499	CHF	1155.520	99.748	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	29.09.2017	29.03.2021	26 829 552	%	97.740	99.827	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	03.11.2017	04.05.2021	26 829 579	CHF	961.320	93.278	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	10.11.2017	10.05.2021	26 829 576	%	97.430	93.354	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	29.11.2017	31.05.2021	26 829 584	%	96.860	93.166	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Euro Stoxx 50 S182645 23.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	22.07.2016	22.07.2021	12 789 805		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convetible on Indices	EUR	1'000.00	22.11.2016	22.11.2021	34 015 749	%	109.350	98.609	99.290		0.000	Y
Principal Protected Note on Gold	CHF	1'000.00	11.12.2009	13.12.2021	10 347 516	%	121.460	88.180	120.000		0.000	Y
Principal Protected Note on Gold	EUR	1'000.00	11.12.2009	13.12.2021	10 347 517	%	128.100	84.840	130.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	31.03.2017	31.03.2022	36 016 369	%	101.580	90.285	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	04.07.2017	04.07.2022	36 828 393	%	98.330	98.887	100.000		0.000	Y
Index Linked Notes on Barclays Capital ARMOUR 7%-Index	EUR	1'000.00	06.08.2010	08.08.2022	11 174 343	%	138.530	96.583	140.000		0.000	Y
Index Linked Notes on BC Armour CHF 7% Index	CHF	1'000.00	06.08.2010	08.08.2022	11 174 344	%	126.270	93.470	120.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	26.04.2017	26.04.2023	26 829 465	%	100.760	98.574	100.000		0.000	Y
Note on Index-Basket	USD	1'000.00	07.05.2015	07.05.2025	26 829 240	%	96.370	81.910	100.000		0.000	Y
Note on Index-Basket	USD	1'000.00	22.10.2015	22.10.2025	26 829 297	%	103.440	81.870	100.000		0.000	Y
Bayerische Landesbank, Muenchen, Deutschland												
Express-Aktienanl. auf N.-Akt. Siemens 17.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.823%	EUR	1'000.00	15.07.2015	15.07.2019	28 516 715		-	98.765	100.000		0.000	Y
BBVA Global Markets BV, Netherlands, Niederlande												
Reverse Convertible on ESTXBNK EUR P 13.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	14.04.2016	14.07.2017	30 363 770		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	05.06.2017	29.12.2017	36 579 145		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	28.06.2017	29.12.2017	36 579 156		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	05.05.2017	07.05.2018	34 905 967		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	2'000.00	19.05.2017	21.05.2018	34 905 968	%	100.520	98.252	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.09.2017	19.09.2018	37 456 773	%	99.940	100.000	100.000	21.10. 19.11. 19.12.	1.029 1.359 1.362	Y
Reverse Convertible on Equities 19.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	2'000.00	19.04.2017	19.10.2018	34 905 962		-	98.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.93%	USD	2'000.00	03.01.2017	02.01.2019	33 094 690		-	97.065	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	2'000.00	02.08.2017	22.01.2019	36 579 166	%	101.100	97.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	2'000.00	02.08.2017	02.08.2019	36 579 169	%	100.350	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	02.08.2017	02.08.2019	36 579 167	%	100.770	99.500	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 29.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.913%	USD	2'000.00	02.03.2017	29.08.2019	34 905 952		-	95.902	100.000		0.000	Y
Structured Notes on HS China Ent Index 6.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.906%	USD	2'000.00	06.09.2016	06.09.2019	33 094 670		-	96.700	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	05.12.2017	05.12.2019	37 456 794	%	98.350	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	2'000.00	21.12.2017	23.12.2019	37 456 796	%	101.200	96.104	100.000		0.000	Y
Protection Participation on S&P 500	USD	2'000.00	06.03.2017	09.03.2020	34 905 954	%	106.360	94.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.049%	USD	2'000.00	21.04.2017	21.04.2020	34 905 963		-	95.209	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Telefonica Br	EUR	1'000.00	02.06.2017	02.06.2020	36 579 143	%	94.650	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 4.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	02.06.2017	02.06.2020	36 579 144		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Telefonica	EUR	1'000.00	12.07.2017	14.07.2020	36 579 155	%	94.950	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 29.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.312%	EUR	1'000.00	02.03.2017	31.08.2020	34 905 953		-	97.760	100.000		0.000	Y
Structured Note 2017-20.06.21 on Repsol SA	EUR	100'000.00	22.06.2016	20.06.2021	37 456 756	%	102.810	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	535.87 542.92 576.90 585.02	N
Index Linked Notes on a Basket of Indi ces S157 13.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	2'000.00	12.11.2015	12.11.2021	30 354 113		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	2'000.00	24.01.2017	24.01.2022	33 094 695	%	106.230	87.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 7.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	07.04.2017	07.04.2022	34 905 961		-	98.643	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 11.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	2'000.00	27.09.2016	11.10.2022	33 094 671		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 12.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	2'000.00	28.09.2016	12.10.2022	33 094 672		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 6.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	2'000.00	24.10.2016	04.11.2022	33 094 673		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 14.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 88.703% 14.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	2'000.00	14.11.2016	14.11.2022	33 094 675		-	91.839	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 2.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	2'000.00	18.11.2016	02.12.2022	33 094 676		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 20.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	2'000.00	12.12.2016	19.12.2022	33 094 686		-	100.000	100.000	20.03.	9.468	N
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.12.2017	19.12.2022	37 456 800	%	97.280	98.937	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 28.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	2'000.00	13.01.2017	31.01.2023	33 094 693		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 3.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	2'000.00	20.01.2017	03.02.2023	33 094 694		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 15.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	2'000.00	31.01.2017	14.02.2023	34 905 943		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 7.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	2'000.00	21.02.2017	07.03.2023	34 905 951		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indicies 9.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	2'000.00	23.02.2017	09.03.2023	34 905 949		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 9.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	2'000.00	23.02.2017	09.03.2023	34 905 950		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 27.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	2'000.00	01.03.2017	27.03.2023	34 905 955		-	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 3.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	2'000.00	20.03.2017	04.04.2023	34 905 959		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 12.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	2'000.00	27.03.2017	11.04.2023	34 905 960		-	100.000	100.000	12.07.	10.750	N
Reverse Convertible on Indices 10.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	2'000.00	27.04.2017	08.05.2023	34 905 964		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 21.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	2'000.00	01.06.2017	21.06.2023	34 905 970		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 15.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.129% 15.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	22.06.2017	22.06.2023	36 579 148		-	98.387	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 29.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 105.939%	CHF	2'000.00	08.06.2017	29.06.2023	36 579 146		-	100.000	100.000	29.09.	0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 5.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	2'000.00	13.06.2017	05.07.2023	36 579 147		-	100.000	100.000	05.10.	9.192	N
Reverse Convertible on Indices 11.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	2'000.00	20.06.2017	11.07.2023	36 579 150		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	2'000.00	20.06.2017	11.07.2023	36 579 152	%	100.630	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 11.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	2'000.00	20.06.2017	11.07.2023	36 579 149		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 11.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	2'000.00	20.06.2017	11.07.2023	36 579 151		-	100.000	100.000		0.000	Y
2.1 % Reverse Convertible on Indices 13.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	2'000.00	13.07.2017	13.07.2023	36 579 164		-	100.000	100.000	13.10.	10.231	N
Reverse Convertible on Indices 18.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 105.279%	CHF	2'000.00	30.06.2017	18.07.2023	36 579 154		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	2'000.00	05.07.2017	26.07.2023	36 579 161		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	2'000.00	03.08.2017	27.07.2023	36 579 171	%	101.610	88.000	100.000		0.000	Y
2.1 % Reverse Convertible on Indices 3.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	2'000.00	13.07.2017	03.08.2023	36 579 163		-	100.000	100.000	03.11.	10.502	N
Reverse Convertible on Indices	CHF	2'000.00	28.08.2017	18.09.2023	37 456 768	%	101.740	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	2'000.00	05.09.2017	26.09.2023	37 456 770	%	100.920	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	2'000.00	05.09.2017	26.09.2023	37 456 771	%	101.370	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	2'000.00	17.10.2017	17.10.2023	37 456 782	%	101.440	100.000	100.000		0.000	N
Reverse Convertible on Indices	USD	2'000.00	17.10.2017	07.11.2023	37 456 783	%	100.910	100.000	100.000		0.000	N
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	05.12.2017	05.12.2023	37 456 793	%	96.640	97.975	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	2'000.00	20.11.2017	11.12.2023	37 456 791	%	99.820	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	2'000.00	21.11.2017	12.12.2023	37 456 792	%	99.580	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	2'000.00	19.12.2017	09.01.2024	37 456 798	%	98.320	100.000	100.000		0.000	Y
BNP Paribas Emissions- u. Handelsgesellschaft mbH, Frankfurt a. Main, Deutschland												
Underlying Tracker auf RWE	EUR	8.50	15.03.2016	17.03.2017	31 923 473		-	100.000	100.000		0.000	N
Capped Bonus-Zert. auf Euro Stoxx 50-Index	EUR	31.47	29.01.2014	25.01.2018	23 536 595	CHF	45.570	96.547	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on BASF N	EUR	72.86	17.10.2016	21.06.2018	34 291 410	CHF	103.400	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Bayer N	EUR	73.44	14.10.2016	31.12.2018	34 280 069	CHF	97.080	100.000	100.000		0.000	Y
Bonus-Zert. auf STOXX Europe 600 Oil & Gas	EUR	100.00	22.08.2014	29.08.2019	27 043 017	CHF	129.270	97.244	100.000		0.000	Y
BNP Paribas Fortis Funding, Luxemburg												
Euro Medium-Term Note 2010-7.8.17 VRN on BNPP Emerging Consumer ER Idx Srs 658 Sr	EUR	1'000.00	07.02.2011	07.08.2017	12 101 482		-	102.000	100.000	07.02. 07.08.	0.000 0.000	N
BP2F Switch to Bond Note VRN on Euro Stoxx 50 Index S792 Sr	EUR	1'000.00	13.02.2013	13.02.2019	20 193 708		n.v.	102.000	100.000	13.02.	0.000	N
Protection Participation on STXG ESG S30EURP Series N098	EUR	1'000.00	13.07.2016	14.07.2025	32 387 613		n.v.	98.261	100.000		0.000	Y
BNP Paribas Issuance B.V., Amsterdam, Niederlande												
Bonus Certificate Plus on Microsoft Corp Shs	USD	1'000.00	06.01.2015	06.01.2017	23 213 190		-	98.312	100.000		0.000	Y
Certificate on BNPP Cdty Mkt N Tgt Vlty 3	EUR	1'000.00	20.01.2012	20.01.2017	14 331 222		-	87.300	95.000		0.000	Y
10.1 % Reverse Convertible on Equities	EUR	5'000.00	22.01.2016	20.01.2017	31 058 193		-	100.000	100.000	20.01.	2.720	Y
7.3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	22.01.2016	20.01.2017	31 058 194		-	100.000	100.000	20.01.	0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Capped Twin Win on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	22.01.2014	23.01.2017	23 212 485		-	97.281	100.000		0.000	Y
Phoenix Worst-of VRN on a Basket of Shs & ADR	USD	1'000.00	14.07.2014	23.01.2017	23 213 607		-	97.837	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on S&P 500 Index	USD	1'000.00	24.01.2014	24.01.2017	21 338 048		-	97.331	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	24.01.2014	24.01.2017	21 338 047		-	98.010	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on Swiss Market Index	CHF	1'000.00	24.01.2014	24.01.2017	21 338 050		-	99.223	100.000		0.000	Y
14.15 % Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	26.01.2016	26.01.2017	31 058 192		-	100.000	100.000	26.01.	58.310	Y
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	27.07.2015	27.01.2017	27 342 214		-	98.955	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	29.07.2015	27.01.2017	27 341 656		-	98.960	100.000		0.000	Y
2.65 % (5.3 % P.A.) Callable Reverse Convertible Worst-of on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	28.01.2015	30.01.2017	23 213 236		-	100.000	100.000	30.01.	0.000	N
2.82 % (5.64 % P.A.) Callable Reverse Convertible Worst-of on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	28.01.2015	30.01.2017	23 213 233		-	100.000	100.000	30.01.	0.86919	N
Cancellable Certificate on a Basket of Fund & ADR	USD	1'000.00	31.01.2014	31.01.2017	23 212 440		-	97.191	100.000		0.000	Y
Certificate on on BNPP Cmdty Mkt Neutral Idx	GBP	1'000.00	08.02.2012	08.02.2017	14 331 245		-	87.780	95.000		0.000	Y
Capped Certificate on Euro Stoxx Banks Index	CHF	1'000.00	13.02.2015	13.02.2017	23 212 352		-	100.000	100.000		0.000	Y
Barrier Reverse Convertible VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	13.02.2015	13.02.2017	23 212 392		-	98.471	100.000		0.000	Y
2 1/2 % Certificate with barrier and Lock-In on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	13.02.2015	13.02.2017	23 212 313		-	100.000	100.000	13.02.	0.000	Y
3.2 % Knock out Worst-of on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	18.02.2015	20.02.2017	23 212 418		-	100.000	100.000	20.02.	0.000	N
Bonus Certificate on S&P 500 Index	USD	1'000.00	21.02.2014	21.02.2017	23 212 480		-	97.611	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	21.02.2014	21.02.2017	23 212 482		-	97.880	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on Swiss Market Index	CHF	1'000.00	21.02.2014	21.02.2017	23 212 477		-	99.521	100.000		0.000	Y
Custom Index-Linked Certificate on BNPP Flexible Fund Stars	EUR	1'000.00	27.02.2012	27.02.2017	14 331 265		-	92.410	100.000		0.000	Y
9.53 % Reverse Convertible on Societe Generale SA Shs	USD	1'000.00	29.02.2016	01.03.2017	27 345 258		-	100.000	100.000	01.03.	11.290	Y
Lock-In Worst-Of Certificates on a Basket of Shs S CE2717BAB	CHF	1'000.00	03.03.2014	03.03.2017	23 478 097		-	99.573	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	05.03.2015	06.03.2017	23 214 226		-	99.786	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on Swiss Market Index	CHF	1'000.00	07.03.2014	07.03.2017	23 213 886		-	99.536	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	06.03.2015	07.03.2017	23 214 184		-	98.208	100.000		0.000	Y
Certificate on Gold Commodity	AUD	1'000.00	08.03.2012	09.03.2017	18 035 826		-	71.150	89.000		0.000	Y
Certificate on BNPP Flex Stars Fund Index	EUR	1'000.00	08.03.2012	09.03.2017	18 035 823		-	87.740	95.000		0.000	Y
3 1/4 % (6 1/2 % P.A.) Autocall with Bonus Coupon on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	10.09.2015	10.03.2017	28 421 428		-	100.000	100.000	10.03.	0.000	N
3.275 % Certificate Plus Worst-of on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	20.03.2015	20.03.2017	27 340 511		-	100.000	100.000	20.03.	0.000	N
Bonus Certificate on Swiss Market Index	CHF	1'000.00	21.03.2014	21.03.2017	23 213 861		-	99.505	100.000		0.000	Y
Bonus Certificates on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	21.03.2014	21.03.2017	23 213 844		-	98.309	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on S&P 500 Index	USD	1'000.00	21.03.2014	21.03.2017	23 213 845		-	97.353	100.000		0.000	Y
1.31 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.06.2016	29.03.2017	31 997 191		-	100.000	100.000	01.03. 29.03.	0.000 0.000	N
1.31 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.06.2016	29.03.2017	32 957 787		-	100.000	100.000	31.01. 01.03. 29.03.	0.000 0.000 0.000	N
Bonus Certificate on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	07.04.2015	03.04.2017	27 341 477		-	98.316	100.000		0.000	Y
Phoenix Worst-of VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	09.04.2015	10.04.2017	27 341 461		-	98.342	100.000		0.000	Y
6.7 % Structure Note on Equities	USD	1'000.00	15.04.2016	14.04.2017	31 997 619		-	100.000	100.000	14.04.		Y
Bonus Certificate on S&P 500 Index	USD	1'000.00	22.04.2014	18.04.2017	23 212 595		-	97.314	100.000		0.000	Y
Certificate on basket of Index	EUR	1'000.00	19.04.2012	19.04.2017	18 035 880		-	92.869	100.000		0.000	Y
2 % Capital Protected Notes on Gold	AUD	1'000.00	17.04.2012	24.04.2017	12 431 308		-	90.080	100.000	24.04.	15.350	Y
Buffered Return Enhanced on IBEX 35 Index	EUR	1'000.00	24.04.2014	24.04.2017	23 214 287		-	98.185	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate Plus on IBEX-35 Index	EUR	1'000.00	05.05.2014	05.05.2017	23 774 722		-	98.268	100.000		0.000	Y
Dolphin on a Basket of Indices	USD	1'000.00	06.05.2014	09.05.2017	23 213 414		-	94.127	97.000		0.000	Y
Twin Win on IBEX 35 Index	USD	1'000.00	09.05.2014	09.05.2017	23 213 399		-	97.038	100.000		0.000	Y
Call Certificate on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	07.05.2015	09.05.2017	27 341 549		-	99.844	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Call Certificate on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	07.05.2015	09.05.2017	27 341 550		-	94.999	95.000		0.000	Y
6 % Barrier Reverse Convertible on LafargeHolcim	CHF	1'000.00	13.11.2015	17.05.2017	30 291 991		-	100.000	100.000	13.02. 17.05.	0.000 0.000	N
Autocallable Reverse Convertible VRN on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	26.05.2015	26.05.2017	27 342 092		-	99.771	100.000		0.000	Y
5 % Lock In Worst of Quanto Certificates on a Basket of Shs S CE1447JOM	CHF	1'000.00	27.05.2014	29.05.2017	23 212 721		-	100.000	100.000	29.05.	1.121	N
5.95 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.05.2016	31.05.2017	31 082 095		-	100.000	100.000	31.05.	12.590	Y
Bonus Certificate Plus on Swiss Market Index SMI	CHF	1'000.00	02.06.2014	02.06.2017	23 212 707		-	99.720	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball VRN on Banco SantanderSA Shs	USD	1'000.00	04.06.2014	06.06.2017	23 212 751		-	97.346	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball VRN on BBVA Shs	USD	1'000.00	04.06.2014	06.06.2017	23 212 750		-	97.346	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.06.2016	07.06.2017	31 997 089		-	98.700	100.000		0.000	Y
Athena on Banco Santander SA Shs	USD	1'000.00	17.06.2014	12.06.2017	23 212 776		-	97.356	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on The Swatch Grp	CHF	1'000.00	14.12.2015	13.06.2017	30 630 909		-	100.000	100.000	14.03. 13.06.	0.000 0.000	N
Capped Booster Certificates on FTSE Italia Index S CE4251UZ	EUR	1'000.00	12.06.2014	14.06.2017	23 212 758		-	98.792	100.000		0.000	Y
Cancellable Leveraged Certificate on Banco Santander SA Shs	EUR	1'000.00	16.06.2014	16.06.2017	24 335 235		-	98.674	100.000		0.000	Y
"worst of" reverse convertible VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	16.06.2015	16.06.2017	27 340 690		-	98.250	100.000		0.000	Y
Autocallable Reverse Convertible Worst-of on a Basket of Shs	USD	1'000.00	18.06.2014	19.06.2017	23 212 813		-	97.174	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	17.06.2015	19.06.2017	27 340 707		-	98.245	100.000		0.000	Y
Autocallable Reverse Convertible with Memory Coup VRN on a Basket of Shs	CAD	1'000.00	17.06.2015	19.06.2017	27 340 806		-	98.052	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	20.06.2014	20.06.2017	23 212 691		-	98.804	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on Swiss Market Index SMI	CHF	1'000.00	20.06.2014	20.06.2017	23 212 690		-	99.720	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	EUR	1'000.00	22.06.2016	22.06.2017	32 714 267		-	95.000	95.000		0.000	Y
Phoenix Worst-of VRN on a Basket of Indices	GBP	1'000.00	20.06.2014	26.06.2017	23 213 489		-	95.524	100.000		0.000	Y
Callable Daily Accrual Worst Of VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	24.06.2015	26.06.2017	27 343 312		-	98.119	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Indices	EUR	1'000.00	27.06.2014	27.06.2017	23 213 545		-	98.771	100.000		0.000	Y
Booster on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	30.06.2015	30.06.2017	27 343 361		-	98.186	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Shs 2.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.985%	EUR	1'000.00	03.07.2015	03.07.2017	27 343 339		-	99.705	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate Plus Worst-of on a Basket of Shs	USD	1'000.00	09.07.2015	11.07.2017	27 342 623		-	98.222	100.000		0.000	Y
DigiCoupon VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	16.07.2014	17.07.2017	23 212 905		-	97.038	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Ralph Lauren Corp Shs	USD	1'000.00	19.07.2016	19.07.2017	31 997 365		-	98.746	100.000		0.000	Y
2.5 % Certificate on BNPP Flexible Stars Funds	NOK	1'000.00	19.07.2012	20.07.2017	18 441 284		-	87.140	100.000		0.000	Y
Leveraged Certificate Plus on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	25.07.2014	25.07.2017	23 213 652		-	98.864	100.000		0.000	Y
Certificate on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	31.01.2014	31.07.2017	23 212 504		-	96.164	100.000		0.000	Y
Certificate on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	31.01.2014	31.07.2017	23 212 514		-	97.313	100.000		0.000	Y
3.4 % Certificate with Barrier and Lock-In on a Basket of Shs 26.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	29.07.2014	31.07.2017	23 214 764		-	100.000	100.000	26.04.	8.240	N
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	29.07.2014	31.07.2017	23 213 664		-	98.847	100.000		0.000	Y
1 % (4 % P.A.) Callable Reverse Convertible Worst-of on a Basket of Indices 8.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.07.2015	31.07.2017	27 342 160		-	100.000	100.000	03.02. 08.05.	0.000 0.000	N
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	30.07.2015	31.07.2017	28 294 091		-	100.000	100.000		0.000	Y
Athena Worst-of on a Basket of Indices	USD	1'000.00	05.08.2015	07.08.2017	27 340 912		-	98.157	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4.35 % (pro rata) Reverse Convertible on Volkswagen Vz 10.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	10.08.2016	10.08.2017	31 997 520		-	100.000	100.000	10.02.	0.000	N
Leveraged Certificates on a Basket of Index & Fund	EUR	1'000.00	11.08.2014	11.08.2017	23 212 949		-	98.813	100.000		0.000	Y
Athena on Hong Kong Hang Seng Index	USD	1'000.00	12.02.2015	14.08.2017	23 213 258		-	97.759	100.000		0.000	Y
Lock In Certificate on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	13.08.2015	14.08.2017	27 341 012		-	100.000	100.000		0.000	Y
0.95 % (3.8 % P.A.) Autocallable Reverse Convertible on Electricite DE France SA Shs	EUR	1'000.00	19.08.2014	21.08.2017	23 212 990		-	98.790	100.000	21.08.	1.191	Y
1 1/4 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities 24.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	24.08.2016	24.08.2017	31 997 461		-	100.000	100.000	24.02. 24.05.	0.000 0.000	N
Leveraged Certificate Plus on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	27.08.2014	29.08.2017	23 213 042		-	96.817	100.000		0.000	Y
Tempo on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	03.09.2014	04.09.2017	23 214 356		-	96.821	100.000		0.000	Y
Leveraged Certificate on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	05.09.2014	05.09.2017	23 214 366		-	98.923	100.000		0.000	Y
Leveraged Certificate Plus on Total SA Shs	USD	1'000.00	11.09.2014	11.09.2017	23 214 403		-	96.625	100.000		0.000	Y
1 7/8 % (7 1/2 % P.A.) Callable Reverse Convertible on a Basket of Indices 10.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	10.09.2015	12.09.2017	27 344 692		-	100.000	100.000	10.03.	0.000	N
4 1/4 % Reverse Convertible on CMS Rt USD 10Y Series 2055	CHF	1'000.00	16.09.2016	15.09.2017	33 792 759		-	100.000	100.000	16.03. 16.06. 15.09.	10.625 10.625 10.506	N
Dropback on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	17.09.2014	18.09.2017	23 214 555		-	96.626	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on S&P 500 Index	USD	1'000.00	19.09.2014	19.09.2017	23 213 036		-	96.260	100.000		0.000	Y
11 % Reverse Convertible on Equities 22.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	22.09.2016	22.09.2017	31 997 653		-	100.000	100.000	22.03.	0.000	N
Cancellable Leveraged Certificate on a Basket of Shs	USD	1'000.00	23.09.2014	25.09.2017	23 214 591		-	96.471	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Indices	USD	1'000.00	25.09.2014	25.09.2017	23 214 614		-	96.310	100.000		0.000	Y
1.45 % Lock In Worst-of on a Basket of Indices	CHF	1'000.00	26.09.2014	26.09.2017	23 214 077		-	100.000	100.000	26.09.	0.500	N
Twin Win on S&P 500 Index	USD	1'000.00	29.09.2014	29.09.2017	23 214 038		-	96.261	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	02.10.2014	02.10.2017	23 214 119		-	96.336	100.000		0.000	Y
Athena Up on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	07.10.2014	09.10.2017	23 214 094		-	96.297	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	13.04.2016	13.10.2017	27 341 957		-	93.862	95.000		0.000	Y
Capital Protected Certificate on Equities	USD	1'000.00	13.04.2016	13.10.2017	27 341 958		-	93.862	95.000		0.000	Y
Autocallable Reverse Convertible Worst-of on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	19.10.2015	19.10.2017	27 343 130		-	99.943	100.000		0.000	Y
3.55 % Lock In Worst-of on a Basket of Shs & ADR	CHF	1'000.00	21.10.2014	23.10.2017	23 214 451		-	100.000	100.000	23.10.	0.52787	N
Capped Booster on Glencore PLC Shs	USD	1'000.00	23.10.2015	23.10.2017	27 342 738		-	98.588	100.000		0.000	Y
Auto Callable Notes VRN on a Basket of Indices	CHF	1'000.00	22.10.2014	24.10.2017	25 487 106		-	99.848	100.000		0.000	Y
5.15 % Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	26.09.2016	26.10.2017	31 997 026		-	98.996	100.000		0.000	Y
1.75 % (7 % p.a.) Reverse Convertible on Equities 28.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	28.10.2016	27.10.2017	34 176 188		-	100.000	100.000	30.01. 28.04.	0.000 0.000	N
Phoenix Snowball VRN on Halliburton Co Shs	USD	1'000.00	30.10.2014	30.10.2017	23 214 477		-	97.223	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Volkswagen Vz	EUR	1'000.00	02.11.2016	02.11.2017	31 997 949		-	100.000	100.000	02.11.	0.000	Y
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	05.11.2014	06.11.2017	23 214 538		-	96.906	100.000		0.000	Y
Certificate Plus on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	04.11.2015	06.11.2017	29 819 028		-	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Volkswagen Vz 10.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	09.11.2016	09.11.2017	34 438 764		-	100.000	100.000	09.02. 10.05.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Equities 17.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.916%	USD	1'000.00	17.05.2016	17.11.2017	32 534 565		-	98.823	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	18.11.2014	20.11.2017	23 214 657		-	96.664	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
0.32 % (3.84 % P.A.) Athena Worst-of on a Basket of Indices 22.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.11.2015	20.11.2017	27 341 853		-	100.000	107.680	18.01. 18.02. 18.03. 18.04. 18.05. 22.05.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	19.05.2016	20.11.2017	31 997 579		-	93.867	95.000		0.000	Y
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	23.11.2015	23.11.2017	27 341 264		-	100.000	100.000		0.000	Y
Autocallable Reverse Convertible Worst-of on a Basket of Indices & Fund 25.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	23.11.2015	24.11.2017	27 341 267		-	100.000	100.000		0.000	Y
Autocallable Reverse Convertible Worst-of on a Basket of Shs	USD	1'000.00	24.11.2015	27.11.2017	27 344 537		-	98.150	100.000		0.000	Y
2.25 % (9 % p.a.) Reverse Convertible on CS Group N 2.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.11.2016	30.11.2017	31 998 027		-	100.000	100.000	02.03.	0.000	N
Autocallable Reverse Convertible Worst-of on a Basket of Shs	USD	1'000.00	01.12.2015	01.12.2017	27 344 539		-	98.150	100.000		0.000	Y
Leveraged Certificate Plus Worst-of on a Basket of Shs	USD	1'000.00	04.12.2015	04.12.2017	27 344 578		-	98.109	100.000		0.000	Y
1.25 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities 7.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	05.12.2016	05.12.2017	31 998 106		-	100.000	100.000	 07.03. 07.03.	 0.000 0.000	N
Bonus Certificate Plus on a Basket of Shs	USD	1'000.00	11.12.2015	11.12.2017	27 344 551		-	100.000	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate Plus on S&P 500 Index	USD	1'000.00	13.12.2013	13.12.2017	21 337 860		-	95.953	100.000		0.000	Y
8.3 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.12.2016	14.12.2017	31 998 345		-	100.000	100.000	14.12.	0.000	N
1.6 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.12.2016	15.12.2017	31 998 305		-	100.000	100.000	16.03. 16.06. 18.09. 15.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
3.35 % Lock-in Worst-Of on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	19.12.2014	19.12.2017	23 213 798		-	100.000	100.000	19.12.	0.176	N
Leveraged Certificate Plus Worst-of on a Basket of Shs	USD	1'000.00	21.12.2015	21.12.2017	27 344 160		-	97.950	100.000		0.000	Y
Autocallable Reverse Convertible VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	22.06.2015	22.12.2017	27 340 842		-	97.164	100.000		0.000	Y
Callable Daily Accrual Worst-of VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	24.06.2015	26.12.2017	27 343 596		-	97.238	100.000		0.000	Y
3 % Callable Reverse Convertible Worst-of on a Basket of Indices & Fund 30.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.10.2014	29.12.2017	23 214 469		-	100.000	100.000	30.06.	0.219	N
Barrier Discount Certificate Worst-of on a Basket of Indices & Fund	USD	1'000.00	07.01.2016	08.01.2018	27 343 757	%	99.380	97.678	100.000		0.000	Y
Callable Daily Accrual VRN on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	14.07.2015	15.01.2018	27 342 148	%	101.020	99.582	100.000		0.000	Y
Certificate on MSCI Inc Index	SGD	1'000.00	21.01.2014	22.01.2018	21 338 101	%	102.570	88.561	95.000		0.000	Y
Certificate on BNPP Cmdty Mkt Neutral Idx	CHF	1'000.00	23.01.2012	23.01.2018	14 331 228	%	126.620	91.000	95.000		0.000	Y
2.65 % Lock In Worst-of on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	30.01.2015	30.01.2018	23 213 275	%	109.710	100.000	100.000	30.01.	0.000	N
Phoenix Worst-of VRN on a Basket of Shs & ADR	CHF	1'000.00	07.02.2014	31.01.2018	23 212 506	%	101.260	98.249	100.000		0.000	Y
0.66 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities 13.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	10.08.2016	12.02.2018	31 997 480		-	100.000	100.000	12.01. 12.02. 13.03.	0.00008 0.00008 0.00007	N
Kick-In Certificates VRN on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	17.02.2016	19.02.2018	27 345 188	%	91.780	100.000	100.000		0.000	Y
Kick-In Certificates VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	17.02.2016	20.02.2018	27 345 189	%	104.820	98.490	100.000		0.000	Y
2.5 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities 24.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	24.08.2016	26.02.2018	31 996 931		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
0.417 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities 27.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	26.08.2016	26.02.2018	31 997 608		-	100.000	100.000	26.01. 27.02.	0.000 0.000	N
Certificate on basket of shares	USD	1'000.00	24.02.2011	27.02.2018	12 484 665	%	102.970	80.070	100.000		0.000	Y
Certificate on basket of shares	EUR	1'000.00	24.02.2011	27.02.2018	12 484 666	%	103.410	79.980	100.000		0.000	Y
3 1/2 % Callable Reverse Convertible Worst-of on Bskt of Indices & Fund	CHF	1'000.00	29.12.2014	01.03.2018	23 213 162	%	101.320	100.000	100.000	01.03. 29.08.	0.40227 0.39572	N
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	13.03.2015	14.03.2018	23 214 232	%	39.590	99.594	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on a Basket of Shares	EUR	1'000.00	18.03.2011	19.03.2018	12 484 719	%	99.760	80.000	100.000		0.000	Y
Certificate on basket of Shares	EUR	1'000.00	22.03.2011	22.03.2018	12 484 737	%	44.530	79.730	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on WTI Crude Oil 26.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.583%	USD	1'000.00	23.03.2017	22.03.2018	34 970 990		-	98.230	100.000		0.000	Y
Call Certificate linked to Worst-of Basket on a Basket of Indices	USD	1'000.00	26.09.2014	26.03.2018	23 214 629	%	94.890	95.051	100.000		0.000	Y
Twin Win on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	26.03.2015	26.03.2018	26 043 368	CHF	1014.310	96.157	100.000		0.000	Y
Athena Worst-of on a Basket of Shs	USD	1'000.00	30.03.2015	02.04.2018	27 344 864	%	98.660	96.321	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.03.2016	03.04.2018	31 983 562	%	115.370	100.000	100.000	29.03.	0.000	N
Call Certificate on a basket of shares	CHF	1'000.00	10.10.2013	09.04.2018	21 338 461	%	101.520	97.294	100.000		0.000	Y
Certificate on BNPP Income Star Fund Index	USD	1'000.00	09.04.2013	10.04.2018	20 438 007	%	110.410	95.196	100.000		0.000	Y
Outperformance Certificate on iSTOXX Eur Next Div Low Risk 50	USD	1'000.00	13.04.2015	13.04.2018	27 420 460	%	82.200	96.767	100.000		0.000	Y
Outperformance Certificate on iSTOXX Eur Next Div Low Risk 50	EUR	1'000.00	13.04.2015	13.04.2018	27 420 457	%	82.750	99.703	100.000		0.000	Y
3 % Kick In Goal with Participation on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	23.04.2015	23.04.2018	27 341 459	%	100.090	100.000	100.000	25.04.	0.000	N
Perles Plus on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	23.10.2015	23.04.2018	27 343 811	CHF	1107.680	100.000	100.000		0.000	Y
Call Certificate on a basket of shares	CHF	1'000.00	24.10.2013	24.04.2018	21 338 363	%	103.610	97.529	100.000		0.000	Y
1/2 % Reverse Convertible on Credit Suisse Group AG Shs	CHF	1'000.00	24.04.2015	24.04.2018	27 342 896	%	36.760	100.000	100.000		0.000	N
12 1/4% Certificate On a Basket of Shares	USD	1'000.00	25.04.2008	25.04.2018	3 934 812	%	101.020	66.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on VanEck Gold Miners 27.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.10.2016	27.04.2018	31 997 905		-	100.000	100.000		0.000	Y
Bonus Note VRN on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	29.04.2015	30.04.2018	27 344 706	%	101.360	99.727	100.000		0.000	Y
Bonus Note VRN on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	29.04.2015	30.04.2018	27 344 603	%	84.250	99.727	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball VRN on STXE6BAR EUR P Index 2.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	29.04.2015	30.04.2018	27 344 604		-	96.847	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	01.05.2015	01.05.2018	27 342 902	%	100.070	96.936	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Shs & ADR	USD	1'000.00	01.05.2015	01.05.2018	27 342 903	%	104.900	96.936	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.05.2017	07.05.2018	36 096 634	%	104.950	98.293	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	17.05.2016	18.05.2018	32 534 555		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	21.11.2016	21.05.2018	31 998 006	%	111.060	100.000	100.000		0.000	Y
Certificate on Basket on Shares	USD	1'000.00	18.05.2011	22.05.2018	12 948 518	%	43.000	82.750	100.000		0.000	Y
3.75% Certificate on basket of shares	CHF	1'000.00	18.05.2011	22.05.2018	12 948 519	%	43.010	86.920	100.000		0.000	Y
Phoenix Worst-of VRN on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	19.05.2014	22.05.2018	23 213 444	%	26.230	99.000	100.000		0.000	Y
Phoenix Worst-of VRN on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	26.05.2014	22.05.2018	23 213 445	%	15.330	99.000	100.000		0.000	Y
Perles Plus on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	23.11.2015	23.05.2018	27 342 735	CHF	1109.750	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	25.11.2016	24.05.2018	31 998 169	%	115.240	98.309	100.000		0.000	Y
certificate on Basket of Shares	EUR	1'000.00	26.05.2011	28.05.2018	12 948 546	%	9.590	80.280	100.000		0.000	Y
Certificate on BNPP Emerg Mkts Loc Debt Fds	USD	1'000.00	28.05.2013	29.05.2018	21 337 661	%	92.160	95.229	100.000		0.000	Y
Phoenix Worst-of VRN on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	27.05.2014	04.06.2018	23 212 705	%	21.580	99.265	100.000		0.000	Y
Certificate on basket of shares	EUR	1'000.00	15.06.2011	15.06.2018	12 948 602	%	58.120	81.210	100.000		0.000	Y
New Fast Booster on a Basket of Shs	CAD	1'000.00	17.06.2014	18.06.2018	23 212 800	%	94.170	93.116	100.000		0.000	Y
New Fast Booster on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	17.06.2014	18.06.2018	23 212 801	%	84.400	93.959	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.06.2015	18.06.2018	27 340 723	%	101.720	96.252	100.000		0.000	Y
3 % Kick In Goal with Participation on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	18.06.2015	18.06.2018	27 342 468	%	102.770	100.000	100.000	19.06.	0.000	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Capital Protected Notes on Dj Global Titans 50 Index	EUR	1'000.00	20.12.2012	21.06.2018	19 738 567	%	140.620	95.069	100.000		0.000	Y
Autocallable Reverse Convertible on basket of Shares	USD	1'000.00	26.03.2013	25.06.2018	20 437 967	%	10.250	94.466	100.000		0.000	Y
Phoenix Worst-of VRN on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	24.06.2014	25.06.2018	23 213 480	%	106.400	99.273	100.000		0.000	Y
Enhanced Return Certificate VRN on a Basket of Indices 23.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.252%	USD	1'000.00	23.06.2015	25.06.2018	27 340 777		-	96.182	100.000		0.000	Y
Phoenix Worst-of VRN on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	26.06.2014	26.06.2018	23 213 506	%	23.410	99.206	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.861%	USD	1'000.00	27.12.2016	26.06.2018	34 971 081		-	97.986	100.000		0.000	Y
Autocallable Booster Worst-of on a Basket of Shs	USD	1'000.00	27.06.2014	29.06.2018	23 213 530	%	87.080	94.437	100.000		0.000	Y
Certiicate 2011-02.07.2018 exp 18.06.2018 on basket of shares	EUR	1'000.00	01.07.2011	02.07.2018	13 170 259	%	10.220	81.240	100.000		0.000	Y
Recovery VRN on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	29.06.2015	02.07.2018	27 343 376	%	39.380	100.000	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on Hang Seng China Entps Ix	USD	100.00	01.07.2015	02.07.2018	27 340 812	CHF	83.740	96.029	100.000		0.000	Y
3.7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.06.2016	02.07.2018	31 997 249	%	113.580	100.000	100.000	30.06.	0.000	N
Apollo Certificate on a Basket of Shares	CHF	1'000.00	04.07.2011	04.07.2018	13 170 265	%	49.180	88.750	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on VanEck Gold Miners 6.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.765%	USD	1'000.00	05.01.2017	05.07.2018	34 971 119		-	98.024	100.000		0.000	Y
Phoenix Worst-of VRN on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	08.07.2014	09.07.2018	23 212 853	%	67.840	99.227	100.000		0.000	Y
Phoenix Worst-of VRN on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	09.07.2014	09.07.2018	23 212 867	%	73.530	99.206	100.000		0.000	Y
Phoenix Worst-of VRN on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	11.07.2014	11.07.2018	23 212 894	%	25.250	99.301	100.000		0.000	Y
Phoenix Worst-of VRN on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	17.07.2014	17.07.2018	23 213 584	%	12.610	99.213	100.000		0.000	Y
Phoenix Worst-of VRN on a Basket of Shs & ADR	USD	1'000.00	21.07.2014	23.07.2018	23 213 605	%	97.370	94.263	100.000		0.000	Y
Phoenix Worst-of VRN on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	22.07.2014	23.07.2018	23 213 610	%	25.430	99.217	100.000		0.000	Y
Phoenix Worst-of VRN on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	22.07.2014	23.07.2018	23 213 614	%	14.210	99.217	100.000		0.000	Y
Phoenix Worst-of VRN on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	07.08.2014	07.08.2018	23 214 777	%	24.300	98.023	100.000		0.000	Y
Autocall VRN on a Basket of Indices 7.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.08.2015	07.08.2018	27 340 945		-	100.000	100.000		0.000	Y
Bond + Call Certificate on basket of 5 Shares	EUR	1'000.00	09.08.2013	09.08.2018	21 337 956	%	114.900	94.149	100.000		0.000	Y
Protection Partcipation on Equities	EUR	1'000.00	15.11.2017	15.08.2018	38 648 466	%	100.930	97.000	97.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.02.2017	16.08.2018	34 970 632	%	59.470	97.966	100.000		0.000	Y
2.6 % Lock-in Certificate on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	19.08.2015	20.08.2018	27 341 110	%	96.120	100.000	100.000	21.08.	0.000	N
Reverse Convertible on CS Group N	USD	1.00	17.02.2017	20.08.2018	34 970 653	CHF	1236.380	95.022	100.000		0.000	Y
8.37 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.04.2017	20.08.2018	36 096 523	%	105.410	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on CS Group N	USD	1.00	22.02.2017	22.08.2018	34 970 689	CHF	1264.220	99.323	100.000		0.000	Y
Autocallable Range Accrual Worst-of VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	29.08.2014	29.08.2018	23 214 353	%	76.460	94.188	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.08.2016	29.08.2018	31 996 944		-	100.000	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	09.09.2016	11.09.2018	31 996 994	%	101.570	100.000	100.000	12.09.	0.000	N
Bond + Call Spread on basket of Index	USD	1'000.00	17.10.2013	17.09.2018	20 438 098	%	126.620	92.480	100.000		0.000	Y
Discounted Athena Worst-of on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	17.09.2014	17.09.2018	23 214 546	%	39.990	99.376	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on STXE6O&G EUR P	USD	1'000.00	17.03.2017	17.09.2018	34 970 907	CHF	1030.080	97.815	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Indices	CAD	1'000.00	15.09.2015	18.09.2018	27 344 651	%	102.500	97.255	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Indices 19.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	16.09.2015	18.09.2018	27 344 671		-	100.000	100.000		0.000	Y
Capped Bonus Certificate on Euro Stoxx 50	EUR	1.00	19.09.2013	19.09.2018	21 338 554	%	135.240	93.133	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.09.2016	19.09.2018	31 997 623	%	99.570	97.931	100.000		0.000	Y
Certificate on BNPP Flexible Stars Fund	EUR	1'000.00	23.09.2013	24.09.2018	21 338 555	%	111.810	93.133	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate Plus on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	26.09.2014	26.09.2018	23 214 034	CHF	1177.040	99.461	100.000		0.000	Y
Phoenix Worst-of VRN on a Basket of Shs & Fund	CHF	1'000.00	26.09.2014	26.09.2018	23 214 578	%	42.300	99.410	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	31.03.2017	01.10.2018	36 096 407	CHF	1015.040	97.816	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	05.10.2016	05.10.2018	32 830 110	CHF	1478.090	100.000	100.000		0.000	Y
Autocallable Range Accrual VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	06.10.2014	09.10.2018	23 214 086	%	70.700	93.499	100.000		0.000	N
3 % Autocallable Reverse Convertible Worst-of on a Basket of Indices 6.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.29%	USD	1'000.00	06.10.2014	09.10.2018	23 214 087		-	93.499	100.000		0.000	Y
Phoenix Worst-of VRN on a Basket of Shs & ADR	CHF	1'000.00	08.10.2014	09.10.2018	23 213 099	%	82.080	99.477	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Indices	USD	1'000.00	09.10.2014	09.10.2018	23 213 117	%	101.840	93.602	100.000		0.000	Y
2.15 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	21.10.2016	22.10.2018	31 997 850	%	101.410	100.000	100.000	23.10.	0.000	N
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.10.2016	22.10.2018	31 997 868	CHF	1432.970	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on STXE6O&G EUR P	USD	1.00	20.04.2017	22.10.2018	36 096 592	CHF	1004.190	97.882	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball VRN on BANCO BILBAO SP ADR	USD	1'000.00	28.10.2014	29.10.2018	23 214 449	%	99.060	94.538	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Indices 10.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	10.11.2015	12.11.2018	27 342 291		-	100.000	100.000		0.000	Y
6.75 % Reverse Convertible on Telecom Italia	CHF	1'000.00	16.11.2017	16.11.2018	39 127 863	%	98.160	100.000	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Bskt of Idx& Cmdty	NOK	1'000.00	21.11.2013	21.11.2018	21 338 335	%	98.140	88.601	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.05.2017	26.11.2018	36 096 168	%	99.080	97.871	100.000		0.000	Y
1.82 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.08.2017	26.11.2018	37 695 960	%	99.080	100.000	100.000	25.09. 25.10. 25.11. 25.12.	0.00117 0.00115 0.00119 0.00115	N
Protection Participation on Funds	USD	1'000.00	29.11.2017	28.11.2018	27 343 348	%	96.980	98.127	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	29.11.2016	29.11.2018	31 998 194		-	100.000	100.000		0.000	Y
1.91 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities 29.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	29.11.2016	30.11.2018	31 998 199		-	100.000	100.000	01.03. 30.05. 29.08. 29.11.	0.79854 0.77196 0.75807 0.79629	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	01.12.2017	03.12.2018	39 332 900	%	101.000	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.12.2016	06.12.2018	31 998 251	CHF	1190.900	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on on Equities	USD	1.00	06.06.2017	07.12.2018	36 096 279	%	96.660	97.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on S & P/ASX 200	AUD	1'000.00	13.12.2016	13.12.2018	31 998 300	CHF	845.230	95.876	100.000		0.000	Y
5.73 % Reverse Convertible Worst-of on a Basket of Indices	EUR	1'000.00	14.12.2015	14.12.2018	27 344 886	%	107.630	100.000	100.000	14.12.	0.000	N
3.35 % Credit linked Certificate on Solactive Low Vol Europe	USD	1'000.00	23.10.2013	27.12.2018	21 338 517	%	112.600	88.543	100.000	29.12.	7.968	N
Autocallable Range Accrual VRN on a Basket of Shs & Ex Rat	USD	1'000.00	10.07.2014	09.01.2019	23 212 880	%	100.730	93.143	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on VanEck Gold Miners 13.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.022%	USD	1'000.00	13.01.2017	14.01.2019	34 971 158		-	97.197	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.07.2017	14.01.2019	37 136 605	%	108.820	97.711	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	13.12.2017	15.01.2019	39 381 668	%	103.400	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	13.12.2017	15.01.2019	39 381 748	%	102.800	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on S&P 500	USD	1'000.00	17.01.2017	17.01.2019	34 971 180	%	109.490	97.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.07.2017	18.01.2019	37 136 652	%	92.160	97.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	20.07.2017	21.01.2019	37 136 635	%	100.500	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	21.07.2017	22.01.2019	37 136 680	%	100.870	97.752	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	24.01.2017	24.01.2019	34 971 255		-	100.000	100.000		0.000	Y
MultiBonus on a Basket of Shs	USD	1'000.00	28.01.2016	28.01.2019	27 343 588	%	111.210	96.459	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	31.01.2017	31.01.2019	34 971 331	CHF	1335.480	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.08.2017	01.02.2019	37 136 677	%	96.530	97.746	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	01.08.2017	01.02.2019	37 136 679	%	95.970	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.08.2017	01.02.2019	37 136 678	%	95.070	100.000	100.000		0.000	Y
Discounted Athena Worst-of on a Basket of Indices & Fund	CHF	1'000.00	12.02.2014	13.02.2019	23 213 313	%	68.980	97.198	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	13.02.2017	13.02.2019	34 970 582	%	77.300	98.598	100.000		0.000	Y
Enhanced Return Note on a Basket of Indices & Fund	USD	1'000.00	18.02.2014	19.02.2019	23 213 839	%	102.260	92.480	100.000		0.000	Y
Phoenix TBG Worst-of VRN on a Basket of Shs 21.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.382%	USD	1'000.00	18.02.2015	19.02.2019	23 212 353		-	95.375	100.000		0.000	Y
Kick-In Certificate VRN on a Basket of Indices & Fd	USD	1'000.00	19.02.2016	19.02.2019	27 345 242	%	95.060	97.605	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Russell 2000	USD	1.00	17.02.2017	19.02.2019	34 970 616	CHF	1077.870	97.048	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on HS China Ent Index	USD	1'000.00	17.02.2017	19.02.2019	34 970 636	%	119.170	97.049	100.000		0.000	Y
5.3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	21.02.2017	21.02.2019	35 465 509	%	101.500	100.000	100.000	21.08.	0.000	N
5.64 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.02.2017	21.02.2019	35 465 510	%	101.600	100.000	100.000	10.08.	0.000	N
Reverse Convertible on ESTXBnk EUR P 22.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	22.02.2017	22.02.2019	34 970 692		-	100.000	100.000		0.000	Y
4 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.08.2017	22.02.2019	34 030 734	%	103.940	100.000	100.000		0.000	Y
(4 % max.)Floating Rate Note with Floor and Cap Floating Rate Series FICRT 1035	EUR	1'000.00	06.03.2014	06.03.2019	22 428 418	%	100.020	100.000	100.000	06.03. 06.06. 06.09. 06.12.	1.875 1.941 2.036 2.064	N
Reverse Convertible on Russell 2000	USD	1.00	06.03.2017	06.03.2019	34 970 722	CHF	1063.120	97.053	100.000		0.000	Y
Certificate on basket of shares	CHF	1'000.00	06.03.2012	07.03.2019	18 035 822	%	52.470	94.620	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Russell 2000	USD	1'000.00	17.03.2017	18.03.2019	34 970 869	CHF	1093.740	96.684	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	17.03.2017	18.03.2019	34 971 003	CHF	987.420	96.679	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.986%	USD	1'000.00	23.03.2017	25.03.2019	34 970 994		-	96.740	100.000		0.000	Y
1.3 % Reverse Convertible on Equities 2.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.03.2017	01.04.2019	36 096 424		-	100.000	100.000	30.06. 02.10.	0.000 0.000	Y
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	02.04.2015	02.04.2019	27 340 546	%	92.420	94.737	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	06.04.2017	08.04.2019	36 096 105	%	112.950	100.000	100.000		0.000	Y
0.98 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	09.10.2017	08.04.2019	37 696 301	%	92.210	100.000	100.000	08.11. 08.12.	0.00009 0.00009	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.04.2017	12.04.2019	36 096 469	%	100.430	96.813	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.818%	USD	1'000.00	18.04.2017	18.04.2019	36 096 522		-	96.913	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.04.2017	19.04.2019	36 096 584	%	90.560	96.956	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.08%	USD	1'000.00	19.04.2017	19.04.2019	36 096 577		-	96.956	100.000		0.000	Y
Enhanced Memory Worst-of VRN on a Basket of Indices & Fund	USD	1'000.00	07.05.2014	07.05.2019	23 213 388	%	140.860	91.331	100.000		0.000	Y
Enhanced Worst-of VRN on a Basket of Indices and Fds	USD	1'000.00	07.05.2014	07.05.2019	23 213 382	%	129.880	91.331	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	10.05.2017	10.05.2019	36 096 660	%	101.270	96.869	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Novartis N	EUR	1'000.00	11.05.2017	13.05.2019	36 096 675	%	106.630	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTXBnk EUR P	EUR	1.00	23.05.2017	23.05.2019	36 096 166	CHF	1161.950	100.000	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate Plus Worst-of on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	16.02.2016	27.05.2019	29 819 036	%	108.380	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	100.00	27.05.2016	28.05.2019	32 636 607	%	120.190	96.875	100.000		0.000	Y
Certificate Call Spread on basket of 4 Shares	EUR	1'000.00	29.05.2013	29.05.2019	20 438 120	%	119.370	94.647	101.500		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.05.2017	30.05.2019	36 096 230	%	76.140	97.013	100.000		0.000	Y
Autocallable Notes VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	01.06.2015	03.06.2019	27 342 069	%	93.370	94.608	100.000		0.000	Y
Call Certificate on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	04.06.2014	04.06.2019	23 212 724	%	105.160	92.325	100.000		0.000	Y
1.7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.12.2017	05.06.2019	27 343 108	%	98.960	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1.00	14.06.2017	14.06.2019	36 096 261	CHF	1008.460	97.048	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.12.2016	20.06.2019	31 998 223	CHF	1170.060	100.000	100.000		0.000	Y
Call Certificate on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	26.06.2014	26.06.2019	23 213 554	%	102.000	98.268	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	02.07.2014	03.07.2019	23 213 544	%	119.800	91.349	100.000		0.000	Y
Booster Certificate on a Basket of Indices	USD	1'000.00	07.07.2014	08.07.2019	23 213 566	%	130.670	91.407	100.000		0.000	Y
Call Certificate on a Basket of Indices	EUR	1'000.00	10.07.2014	10.07.2019	23 212 878	%	111.930	96.771	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.01.2017	15.07.2019	31 998 411	CHF	1101.480	100.000	100.000		0.000	Y
Call Certificate on BNP Next Div Low Risk Europe Ix	USD	1'000.00	16.07.2014	16.07.2019	23 212 916	%	102.660	91.908	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.07.2017	18.07.2019	37 136 651	%	107.860	96.797	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 19.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.953%	USD	1'000.00	19.07.2016	19.07.2019	31 997 342		-	97.546	100.000		0.000	Y
Capped LookBack on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	29.07.2014	29.07.2019	23 213 670	%	112.160	96.874	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Shs 2.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	29.07.2015	29.07.2019	27 341 661		-	94.196	100.000		0.000	Y
Call Certificate on EURO STOXX Select Dividend 30 Ix	USD	1'000.00	30.07.2014	30.07.2019	23 213 681	%	112.090	91.511	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1.00	30.01.2017	30.07.2019	34 971 159	CHF	1174.260	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	01.12.2017	31.07.2019	38 648 321	%	96.730	100.000	100.000		0.000	Y
Phoenix Worst-of VRN on a Basket of Shs	USD	1'000.00	01.08.2014	01.08.2019	23 214 742	%	14.630	91.758	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	02.08.2017	02.08.2019	37 136 708	%	100.090	98.792	100.000		0.000	Y
Bond + Call Certificate on Next Div Low Risk Europe Index	EUR	1'000.00	04.08.2014	05.08.2019	23 213 689	%	102.240	96.902	100.000		0.000	Y
Notes on a Basket of Funds	USD	1'000.00	05.08.2014	05.08.2019	23 213 656	%	95.860	91.506	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.08.2017	05.08.2019	37 696 040	%	93.770	96.889	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on LafargeHolcim	CHF	56.30	07.11.2017	07.08.2019	38 648 388	CHF	53.510	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1.00	21.02.2017	21.08.2019	34 970 742	CHF	1106.310	96.056	100.000		0.000	Y
Call Certificate on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	28.08.2014	28.08.2019	23 213 046	%	111.500	91.736	100.000		0.000	Y
Transition VRN on ENI SPA Shs	EUR	1'000.00	02.09.2014	02.09.2019	23 214 351	%	79.740	97.513	100.000		0.000	Y
Call Certificate on a Basket of Shs	USD	1'000.00	08.09.2014	09.09.2019	23 214 368	%	101.230	91.421	100.000		0.000	Y
Call Certificate on a Basket of Shs	USD	1'000.00	16.09.2014	13.09.2019	23 214 544	%	99.970	91.590	100.000		0.000	Y
Call Spread Certificate on Hang Seng China Enterprises Ix	USD	1'000.00	16.09.2014	16.09.2019	23 214 435	%	107.440	91.590	100.000		0.000	Y
Call Certificate on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	17.09.2014	17.09.2019	23 214 607	%	99.720	97.588	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate Plus on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	18.09.2014	18.09.2019	23 214 565	%	120.460	91.504	100.000		0.000	Y
Call Certificate on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	19.09.2014	19.09.2019	23 214 572	%	104.050	91.307	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 27.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.986%	USD	1'000.00	27.09.2017	27.09.2019	37 696 018		-	96.754	100.000		0.000	Y
Phoenix Second Worst-of VRN on a Basket of Shs 9.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.467%	EUR	1'000.00	07.10.2014	07.10.2019	23 214 093		-	97.462	100.000		0.000	Y
Enhanced Return Certificate VRN on a Basket of Indices	EUR	1'000.00	08.10.2014	08.10.2019	23 214 101	%	126.050	97.590	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.10.2017	17.10.2019	38 648 236	%	99.410	96.536	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.10.2017	21.10.2019	37 696 386	%	97.960	96.613	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.10.2017	21.10.2019	37 696 388	%	97.420	96.613	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on iShs MSCI Em Mk 26.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.379%	USD	1'000.00	26.10.2016	28.10.2019	31 997 895		-	96.782	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.10.2017	30.10.2019	37 696 089	%	100.980	96.499	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.11.2017	04.11.2019	38 648 347	%	97.620	96.448	100.000		0.000	Y
Phoenix Worst-of VRN on a Basket of Shs and ADR	CHF	1'000.00	07.11.2014	07.11.2019	23 214 524	%	17.530	99.018	100.000		0.000	Y
Athena Worst-of on a Basket of Indices 13.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.472%	USD	1'000.00	13.11.2014	13.11.2019	23 214 669		-	91.574	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.11.2017	13.11.2019	38 648 379	%	98.010	96.452	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTXBnk EUR P	EUR	1.00	26.05.2017	26.11.2019	36 096 193	CHF	1194.120	100.000	100.000		0.000	Y
Autocallable Reverse Convertible Worst-of on a Basket of Shs	USD	1'000.00	07.10.2014	29.11.2019	23 213 105	%	44.070	90.454	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	30.11.2017	02.12.2019	37 696 421	CHF	944.300	96.387	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	07.12.2016	09.12.2019	31 998 276	CHF	1161.490	95.710	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1.00	15.06.2017	16.12.2019	36 096 288	%	103.130	96.168	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on S&P 500	USD	1'000.00	22.06.2016	23.12.2019	31 997 151	%	127.210	96.368	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
1 1/2 % (3 % p.a.) Underlying Tracker on Indices	CHF	1'000.00	27.12.2016	27.12.2019	31 998 396	%	97.790	100.000	100.000	27.06. 27.12.	0.000 0.000	N
4.45 % Certificates Cr Lkd on Petrobras Intl Fin Co S.A. Ref Ent	USD	1'000.00	15.12.2014	30.12.2019	26 259 254	%	99.830	100.000	100.000	30.12.	43.364	N
Call Certificate on BNPP Fd - Income Fd Stars Ix	USD	1'000.00	29.12.2014	30.12.2019	23 213 782	%	104.150	91.934	100.000		0.000	Y
Enhanced Return Certificate Worst-of VRN on a Basket of Indices	EUR	1'000.00	30.12.2014	30.12.2019	23 213 181	%	131.000	98.093	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate Plus on Hong Kong Hang Seng Index	USD	1'000.00	14.01.2015	14.01.2020	23 213 212	%	108.760	92.337	100.000		0.000	Y
Call Certificate on a Basket of Shs	USD	1'000.00	20.01.2015	21.01.2020	23 213 224	%	103.820	92.523	100.000		0.000	Y
Bond plus Call Certificate on BNPP DR Market Neutral Target Ix	USD	1'000.00	22.01.2015	22.01.2020	23 213 216	%	102.560	92.337	100.000		0.000	Y
Perles Plus on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	27.01.2016	28.01.2020	27 342 810	CHF	1704.060	99.684	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1.00	02.02.2017	03.02.2020	34 971 347	CHF	1251.290	100.000	100.000		0.000	Y
Autocallable Reverse Convertible Worst-of on a Basket of Shs	USD	1'000.00	30.01.2015	05.02.2020	23 213 263	%	93.950	92.805	100.000		0.000	Y
EDS Booster on iSTOXX Europe Next Div Risk Ix	EUR	1'000.00	06.02.2015	06.02.2020	23 212 334	%	89.420	98.410	100.000		0.000	Y
Booster Linked on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	06.02.2015	06.02.2020	23 212 333	%	98.580	98.410	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	08.02.2017	10.02.2020	34 970 619	%	83.070	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	10.02.2017	10.02.2020	34 970 654	%	100.490	95.022	100.000		0.000	N
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	10.02.2017	10.02.2020	34 970 647	%	100.130	95.022	100.000		0.000	Y
Athena Worst-of on a Basket of Shs	USD	1'000.00	19.02.2015	19.02.2020	23 212 384	%	110.730	93.188	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BNP Paribas-A- 22.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	22.02.2017	24.02.2020	34 970 691		-	100.000	100.000		0.000	Y
Certi Plus on Basket of Indices	EUR	1'000.00	25.02.2015	25.02.2020	23 212 396	%	97.580	98.480	100.000		0.000	Y
Bond Plus Max Memory Call on a Basket of Shs	USD	1'000.00	25.02.2015	26.02.2020	23 212 413	%	96.050	92.019	100.000		0.000	Y
2 % Reverse Convertible Worst-of on a Basket of Shs	DKK	1'000.00	26.02.2015	26.02.2020	23 212 424	%	99.590	100.000	100.000	27.02.	2.879	N
Call Certificate on Nasdaq Index	USD	1'000.00	26.02.2015	26.02.2020	23 214 166	%	113.040	91.996	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.376%	USD	1'000.00	06.09.2017	09.03.2020	37 696 174		-	96.200	100.000		0.000	Y
Call Certificate on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	11.03.2015	11.03.2020	23 214 216	%	99.270	92.280	100.000		0.000	Y
Call Certificate on BNPP Fd Income Fund Stars Index	USD	1'000.00	11.03.2015	11.03.2020	27 343 783	%	97.720	91.670	100.000		0.000	Y
Double Note on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	13.03.2015	12.03.2020	23 214 238	%	91.840	92.065	100.000		0.000	Y
Transition VRN on Zurich Ins Grp AG Shs	CHF	1'000.00	17.03.2015	17.03.2020	27 340 470	%	96.460	100.000	100.000		0.000	Y
Enhanced Return Note VRN on a Basket of Indices & Fd	EUR	1'000.00	24.03.2015	24.03.2020	27 340 533	%	122.840	98.594	100.000		0.000	Y
Enhanced Return Note VRN on a Basket of Indices & Fd	USD	1'000.00	24.03.2015	24.03.2020	27 340 531	%	125.050	91.869	100.000		0.000	Y
Athena Worst-of on a Basket of Indices 27.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.758%	EUR	1'000.00	27.03.2015	27.03.2020	27 344 838		-	98.759	100.000		0.000	Y
1 % Certificates Cr Lnk on UBS AG Stamford Reference Entity	CHF	1'000.00	27.01.2015	30.03.2020	26 259 265	%	101.000	100.000	100.000	30.03.	10.000	N
4.2 % Certificates on Bombardier Inc Refernce Entity	EUR	1'000.00	25.03.2015	30.03.2020	26 259 288	%	105.540	100.000	100.000	30.03.	44.912	N
Athena Worst-of on a Basket of Shs	USD	1'000.00	30.03.2015	30.03.2020	27 340 518	%	13.840	91.695	100.000		0.000	Y
Athena on Repsol SA Shs	JPY	10'000.00	30.03.2015	30.03.2020	27 340 524	%	111.060	99.224	100.000		0.000	Y
Protection Participation on	USD	1'000.00	31.03.2017	31.03.2020	34 970 996	%	98.980	94.813	100.000		0.000	Y
Protection Participation on	USD	1'000.00	31.03.2017	31.03.2020	34 970 982	%	97.510	94.522	100.000		0.000	Y
Athena Worst-of on a Basket of Index & Fund	USD	1'000.00	01.04.2015	08.04.2020	27 341 445	%	135.870	92.775	100.000		0.000	Y
Athena Worst-of on a Basket of Shs	USD	1'000.00	08.04.2015	15.04.2020	27 341 502	%	116.040	92.565	100.000		0.000	Y
2 1/4 % (4 1/2 % P.A.) Reverse Convertible Worst-of on a Basket of Indices	CHF	1'000.00	30.04.2015	30.04.2020	27 344 860	%	95.190	100.000	100.000	02.05. 30.10.	22.561 22.315	N
Protection Participation on BlackRock GlobalFunds	USD	1'000.00	03.05.2017	04.05.2020	36 096 652	%	97.250	94.905	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on IBEX 35	EUR	1'000.00	05.05.2017	05.05.2020	33 950 579	CHF	1112.610	100.000	100.000		0.000	Y
Certificate on basket of 8 Shares	CHF	1'000.00	11.05.2012	19.05.2020	18 441 225	%	43.480	93.260	100.000		0.000	Y
Callable Bond Plus Call on a Basket of Indices	EUR	1'000.00	19.05.2015	19.05.2020	27 341 612	%	98.020	98.266	100.000		0.000	Y
Enhanced Return Certificate VRN on a Basket of Indices 19.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	19.05.2015	19.05.2020	27 341 611		-	92.087	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Enhanced Return Certificate VRN on a Bskt of Indices and Funds 20.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.838%	USD	1'000.00	19.05.2015	19.05.2020	27 341 613		-	92.087	100.000		0.000	Y
New Fast Booster on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	20.05.2014	20.05.2020	23 213 455	%	78.620	90.829	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.05.2017	26.05.2020	36 096 187	%	97.990	95.343	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1.00	26.05.2017	26.05.2020	36 096 191	CHF	1168.640	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1.00	26.05.2017	26.05.2020	36 096 775	CHF	1163.790	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	11.12.2017	11.06.2020	27 343 070	CHF	971.880	95.231	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1.00	14.06.2017	15.06.2020	36 096 300	CHF	941.050	95.208	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	19.06.2017	16.06.2020	36 096 205	%	92.700	100.000	100.000		0.000	Y
Athena Worst-of on a Basket of Indices	USD	1'000.00	18.06.2015	18.06.2020	27 340 724	%	106.460	91.382	100.000		0.000	Y
Enhanced Return Certificate VRN on Bskt of Indices & Fund 20.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.483%	USD	1'000.00	19.06.2015	19.06.2020	27 340 739		-	91.179	100.000		0.000	Y
Athena Worst-of on a Basket of Indices	EUR	1'000.00	24.06.2015	23.06.2020	27 343 595	%	112.640	97.130	100.000		0.000	Y
Callable Bond Plus Call on STOXX Europe 600 Basic Res Ix	USD	1'000.00	01.07.2015	01.07.2020	27 342 591	%	110.960	91.628	100.000		0.000	Y
Enhanced Return Certificate VRN on a Bskt of Indices & Funds	EUR	1'000.00	01.07.2015	01.07.2020	27 342 142	%	120.520	97.352	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.07.2017	06.07.2020	37 136 544	%	98.800	95.194	100.000		0.000	Y
Floored Capital Protected Notes on Euro Stoxx 50 Index Reg-S	CHF	1'000.00	07.07.2011	07.07.2020	12 985 438	%	120.460	83.528	100.000		0.000	Y
Floored Capital Protected Notes on Eurostoxx 50 Index Reg-S	EUR	1'000.00	07.07.2011	07.07.2020	12 985 439	%	137.110	73.444	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	12.11.2014	09.07.2020	23 214 663	%	37.570	98.444	100.000		0.000	Y
Lastlook Express Certificate on a Basket of Indices	USD	1'000.00	08.07.2015	09.07.2020	27 342 601	CHF	1142.810	91.176	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.07.2017	13.07.2020	37 136 608	%	102.930	100.000	100.000		0.000	Y
1.75 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.07.2017	17.07.2020	37 136 637	%	100.500	100.000	100.000	17.10.	4.434	N
1.75 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities 17.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.952%	USD	1'000.00	17.07.2017	17.07.2020	37 136 636		-	100.000	100.000	17.10.	4.434	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.07.2017	20.07.2020	37 136 589	%	103.310	94.926	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CAD	1'000.00	26.07.2017	27.07.2020	37 136 662	%	99.960	95.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.07.2017	28.07.2020	37 136 725	%	100.070	100.000	100.000		0.000	Y
Phoenix VRN on	EUR	1'000.00	31.07.2015	31.07.2020	27 340 946	%	85.860	97.905	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.08.2017	03.08.2020	37 136 754	%	79.190	95.029	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Basket	USD	1'000.00	08.02.2017	10.08.2020	34 970 614	%	103.420	94.009	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	10.08.2017	10.08.2020	37 696 027	%	96.180	95.038	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	17.02.2017	17.08.2020	34 971 328	CHF	1244.020	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.08.2017	17.08.2020	37 696 084	%	100.540	95.012	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.08.2017	31.08.2020	37 696 106	%	97.870	95.033	100.000		0.000	Y
Athena Worst-of on a Basket of Shs 6.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.088%	USD	1'000.00	01.09.2015	01.09.2020	27 344 434		-	92.613	100.000		0.000	Y
Phoenix Worst-of VRN on a Basket of Index & Fund 11.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.675%	USD	1'000.00	10.09.2014	10.09.2020	23 214 392		-	88.738	100.000		0.000	Y
Express Certificate on a Basket of Indices & Fund	USD	321.25	16.09.2015	16.09.2020	27 344 102	CHF	575.300	91.750	100.000		0.000	Y
Phoenix Worst-of VRN on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	06.11.2014	21.09.2020	23 214 520	%	93.660	96.942	100.000		0.000	Y
2.9 % Certificate on a Basket of Indices	USD	1'000.00	23.09.2014	23.09.2020	23 214 583	%	87.980	88.600	100.000		0.000	Y
(2 1/4 % - 0 %) Certificate on a Basket of Indices	EUR	1'000.00	24.09.2014	24.09.2020	23 214 600	%	92.510	96.170	100.000		0.000	Y
1 3/4 % zero recovery Certificates Cr Lnk on a Basket of Reference Entity	CHF	1'000.00	04.09.2015	30.09.2020	27 785 280	%	100.390	100.000	100.000	30.09.	17.500	N
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1.00	31.03.2017	01.10.2020	34 971 039	CHF	918.460	93.696	100.000		0.000	Y
Call Certificate on a Basket of Shs	USD	1'000.00	08.10.2014	13.10.2020	23 214 078	%	96.460	87.666	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1.00	18.04.2017	20.10.2020	36 096 119	CHF	914.210	93.773	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	21.10.2015	21.10.2020	27 343 161	%	63.200	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.10.2017	26.10.2020	38 648 306	%	95.780	94.473	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Shs & ADR	CHF	1'000.00	09.11.2015	09.11.2020	27 342 284	%	29.870	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
LastLook Memory Express Certificates on a Basket of Shs	JPY	100'000.00	20.11.2015	20.11.2020	27 341 265	%	85.680	99.166	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.05.2017	23.11.2020	36 096 150	%	93.300	94.109	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on US Steel	USD	1'000.00	27.11.2017	27.11.2020	27 340 870	%	105.100	94.286	100.000		0.000	Y
Callable Bond + Call on Swiss Market Index SMI	USD	1'000.00	10.12.2015	10.12.2020	27 342 778	%	102.780	92.079	100.000		0.000	Y
2.125 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.12.2017	14.12.2020	27 342 672	%	100.440	93.972	100.000		0.000	Y
Protection Participation on STXE S50EURP	USD	1'000.00	12.07.2017	11.01.2021	37 136 549	%	94.510	94.156	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball VRN on iShares MSCI EM MK Fd 25.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	25.01.2016	25.01.2021	27 343 728		-	93.353	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball Worst-of VRN on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	08.02.2016	08.02.2021	31 350 527	%	31.400	100.000	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball Worst-of on a Basket of Shs & ADR	EUR	1'000.00	08.02.2016	08.02.2021	27 340 445	%	30.640	99.778	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	23.02.2017	23.02.2021	34 970 771	%	102.580	92.558	100.000		0.000	Y
Apollo VRN on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	11.03.2014	11.03.2021	23 213 890	%	76.410	90.493	100.000		0.000	N
Reverse Convertible on BSKT	CHF	1'000.00	29.03.2016	29.03.2021	27 342 005	%	33.500	100.000	100.000		0.000	Y
1/2 % Protection Participation on STX HDLB 50 EUR P	USD	1'000.00	29.03.2016	29.03.2021	27 342 004	%	99.550	93.296	100.000		0.000	Y
0.25 % (0.5 % p.a.) Protection participation on Equities	USD	1'000.00	31.03.2017	31.03.2021	36 096 409	%	97.270	92.266	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	05.04.2016	05.04.2021	27 341 296	%	121.630	93.204	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 7.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	07.04.2016	07.04.2021	31 997 298		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	07.04.2016	07.04.2021	31 997 202	%	79.060	93.685	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.10.2017	23.04.2021	38 648 289	%	99.770	93.669	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	27.04.2016	27.04.2021	31 997 821	%	47.990	93.846	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	22.11.2017	25.05.2021	38 648 357	CHF	983.020	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	22.12.2017	22.06.2021	27 343 069	%	98.520	92.896	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on FTSE MIB	USD	1'000.00	05.07.2016	28.06.2021	31 997 224	%	114.250	94.669	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on STXE6Bnk EUR P 11.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	11.07.2016	12.07.2021	31 997 256		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on CAC 40	USD	1'000.00	20.09.2017	20.09.2021	37 696 219	%	97.050	93.678	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Teva Pharma Ind	USD	1'000.00	22.09.2017	22.09.2021	37 696 278	%	66.170	93.154	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	10.11.2017	10.11.2021	38 648 316	CHF	991.140	100.000	100.000		0.000	Y
ProtectionParticipation on Ethical Europe Climate Care Index	USD	1'000.00	23.11.2015	16.11.2021	30 098 119	%	91.750	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SX5E Dividend Fut Dec21	USD	82.54	08.07.2016	24.12.2021	31 997 324	CHF	109.950	94.330	100.000		0.000	Y
Phoenix Worst-of VRN on a Basket of Shs 30.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.01.2015	28.01.2022	23 213 246		-	100.000	100.000		0.000	Y
Phoenix Worst-of VRN on a Basket of Shs	NOK	1'000.00	03.02.2015	02.02.2022	23 213 251	%	101.090	90.473	100.000	03.02.		Y
Performix Certificates VRN on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	05.02.2014	07.02.2022	23 213 802	%	92.900	87.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 14.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	14.02.2017	14.02.2022	34 970 673		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 30.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.623%	USD	1'000.00	28.02.2017	01.03.2022	34 970 783		-	90.519	100.000		0.000	Y
EDS Snowball VRN on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	10.03.2015	09.03.2022	23 214 196	%	86.090	87.390	100.000		0.000	Y
Phoenix Snowball VRN on EURO STOXX Select Div 30 Ix	EUR	100'000.00	29.04.2015	04.05.2022	27 342 952	%	97.310	97.761	100.000		0.000	Y
Phoenix TBG Worst-Of VRN on a Basket of Shs	AUD	1'000.00	06.05.2015	06.05.2022	27 342 951	%	86.170	82.870	100.000		0.000	Y
Phoenix TBG Worst-Of VRN on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	11.05.2015	13.05.2022	27 343 008	%	99.680	99.733	100.000		0.000	Y
Phoenix TBG Worst-of VRN on a Basket of Shs	NOK	1'000.00	11.05.2015	13.05.2022	27 343 010	%	98.280	87.073	100.000		0.000	Y
1 % Protection Participation on Basket	AUD	1'000.00	15.05.2017	17.05.2022	36 096 734	%	94.590	92.943	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	07.07.2017	07.07.2022	37 136 578	%	89.390	90.943	100.000		0.000	Y
Autocallable Certificate Plus on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	10.07.2015	08.07.2022	27 343 382	%	71.160	99.461	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	19.07.2017	19.07.2022	37 136 598	%	101.250	90.613	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 22.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.348%	USD	1'000.00	22.08.2017	22.08.2022	37 696 095		-	91.253	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.08.2017	23.08.2022	37 696 101	%	102.270	91.041	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	03.10.2017	03.10.2022	37 696 014	%	97.710	90.943	100.000		0.000	Y
Protection Participation on BNPP Fd-Income Fund	USD	1'000.00	09.02.2017	18.10.2022	34 970 620	%	91.980	89.102	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	20.11.2017	21.11.2022	37 696 424	%	100.490	90.048	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.11.2017	23.11.2022	39 233 123	%	98.840	99.035	100.000		0.000	Y
2 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	27.11.2017	28.11.2022	37 696 420	%	99.460	94.639	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	22.11.2017	30.11.2022	27 342 589	%	97.970	94.841	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.12.2017	20.12.2022	27 341 659	%	97.810	89.542	100.000		0.000	Y
2 % EDS Booster on iStoxx Europe Next Div Ix	CHF	1'000.00	24.12.2015	27.12.2022	27 343 692	%	83.050	100.000	100.000	27.12.	20.000	N
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	02.06.2017	02.06.2023	36 096 243	%	103.150	89.003	100.000		0.000	Y
2.55 % Structured Note on 3.875 AF KLM 21 Series FICRT 1828 SM	CHF	1'000.00	08.06.2016	05.07.2023	30 457 948	%	100.120	100.000	100.000	05.07.	25.500	N
5.15 % Call Certificate on BNPP Newcits Fund Stars Entity	EUR	1'000.00	05.02.2014	15.11.2023	23 212 515	%	103.520	82.601	100.000		0.000	Y
(0 % min.) Bond + Driver Coupons 2015-17.3.25 Floating Rate Reg-S	USD	1'000.00	17.03.2015	17.03.2025	27 340 480	%	83.720	80.090	100.000	17.03.	10.877	Y
Reverse Convertible on STXE6O&G EUR P	USD	1'000.00	15.09.2017	15.09.2025	37 696 230	%	99.080	85.611	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	30.03.2017	30.03.2027	36 096 108	%	97.880	79.113	100.000		0.000	Y
BNP Paribas SA, Paris, Frankreich												
(1.3 % - 2.1 %) Step-Up Note Step-Up Series E15188 Senior	EUR	1'000.00	26.09.2012	26.09.2017	19 279 355		-	100.000	100.000	26.03. 26.09.	11.238 11.993	N
3.55 % Credit Linked Notes Credit Linked on Axa Ref Ent Srs E15196	CHF	1'000.00	27.08.2012	30.09.2017	19 316 755		-	100.000	100.000	30.09.	35.500	N
(4 % min./6 % max.) Credit Linked Note FRN Cr Lkd on Unicredit SpA Reference Entity	EUR	1'000.00	21.12.2012	08.01.2018	20 144 543		n.v.	100.000	100.000	08.01.	42.922	N
Notes on a Basket of Currencies S E15502	EUR	1'000.00	25.01.2013	25.01.2018	20 523 006	%	99.510	94.996	100.000		0.000	Y
(no min.) Credit Linked Note FRN Crd Linked on Standard Chartered Bk Ref Ent	CHF	10'000.00	29.08.2013	28.09.2018	22 154 050	%	98.700	100.000	100.000	28.03. 28.06. 28.09. 28.12.	30.445 30.470 30.495 30.600	N
Euro Medium-Term Note on a Bskt of Currencies S16705 Sr	EUR	1'000.00	15.04.2014	15.04.2019	24 158 871	%	99.430	95.337	100.000		0.000	Y
2.3 % Zero Recovery Notes Cr Lkd on Glencore Fin (Europe) SA Ent S16698	CHF	1'000.00	22.04.2014	28.06.2019	24 158 868	%	100.860	100.000	100.000	28.06.	23.000	N
(1 1/2 % min./6 % max.) Floored & Capped Floater Note Floating Rate Series E16361 Senior	USD	1'000.00	23.01.2014	23.01.2020	22 440 584	%	98.870	100.000	100.000	23.01. 23.04. 23.07. 23.10.	3.828 3.733 3.587 3.779	N
(1/4 % min. / 4 % max.) Capped Floored Floater Notes Floating Rate Series 17201 Senior	EUR	1'000.00	12.03.2015	12.03.2020	24 159 059	%	99.690	100.000	100.000	12.03. 12.06. 12.09. 12.12.	0.67137 0.67853 0.71696 0.72765	N
BSI Overseas (Bahamas) Ltd., Nassau, Bahamas												
4.96 % Reverse Convertibles on Shares-Basket	CHF	1'000.00	22.01.2016	25.01.2017	31 275 051		-	100.000	100.000	25.01.	0.000	Y
9.42 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.01.2016	25.01.2017	31 275 053		-	100.000	100.000	25.01.	0.000	Y
4.46 Reverse Convertible on Index-Basket	CHF	1'000.00	04.02.2016	07.02.2017	31 404 297		-	100.000	100.000	07.02.	0.000	Y
10.2 % Reverse Convertible (exp.03.02.17) on Equities	CHF	1'000.00	07.08.2015	10.02.2017	29 169 045		-	100.000	100.000	10.02.	0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Canadian Imperial Bank of Commerce, Toronto, Kanada												
4.225 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.04.2017	20.04.2018	36 472 431	%	102.810	100.000	100.000	20.07. 20.10.	0.000 0.000	N
Citigroup Global Markets Deutschland AG & Co.KGaA, Frankfurt, Deutschland												
Underlying Tracker auf Wire Card	EUR	27.07	04.04.2016	20.06.2017	32 091 727		-	100.000	100.000		0.000	Y
Citigroup Inc., New York, USA												
Regd.Worst of Call Notes on a Basket of Shs	USD	1'000.00	30.04.2014	16.04.2019	13 020 594	%	99.250	91.674	100.000		0.000	Y
Commerzbank AG, Frankfurt am Main, Deutschland												
15.2 % Reverse Convertible on Equities Series N8035	CHF	5'000.00	13.05.2016	13.02.2017	32 454 877		-	100.000	100.000	13.02.	0.000	Y
Bonus-Zert. auf Euro Stoxx 50-Index	EUR	100.00	15.02.2013	15.02.2017	20 663 418		-	96.532	100.000		0.000	Y
8 1/2 % Structured Notes on a Basket of Shs Series N7521	CHF	1'000.00	19.01.2016	21.02.2017	30 995 859		-	100.000	100.000	21.02.	0.000	Y
Capped Bonus Bond auf N.-Akt. Daimler	CHF	1'000.00	27.02.2015	27.02.2017	27 227 294		-	100.000	100.000		0.000	Y
Autocall Phoenix-Zert. auf Aktien-Basket 10.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	20.03.2012	20.03.2017	18 142 086		-	97.979	100.000		0.000	Y
Phoenix-Zert. auf Aktien-Basket	CHF	1'000.00	25.03.2011	23.03.2017	12 721 418		-	90.689	100.000		0.000	Y
Autocall-Phoenix Note VRN on a Bskt of Shs Series N5845	USD	1'000.00	11.05.2015	09.05.2017	28 042 717		-	98.430	100.000		0.000	Y
Structured Note on Euro Stoxx 50 Series N8040	NOK	1'000.00	09.05.2016	09.05.2017	32 465 550		-	100.000	100.000	09.02. 09.05.	0.85264 0.77475	N
10 % Reverse Convertible on Mgm Resorts Intl Ser N8062	USD	1'000.00	16.05.2016	16.05.2017	32 531 189		-	100.000	100.000	16.05.	12.170	Y
Phoenix Note auf Index-Basket 17.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	17.11.2015	17.05.2017	30 342 971		-	100.000	100.000		0.000	Y
Structured Note on Euro Stoxx 50 Series N8121	CHF	1'000.00	23.05.2016	22.05.2017	32 621 805		-	100.000	100.000	23.02. 22.05.	0.000 0.000	N
2.8 % Reverse Convertible auf S&P 500	EUR	1'000.00	26.05.2016	26.05.2017	32 656 653		-	100.000	100.000	26.05.	0.000	N
Structured Notes on Transocean Ltd Shs Series N7353	CHF	1'000.00	01.12.2015	31.05.2017	30 576 562		-	100.000	100.000		0.000	Y
Barrier Reverse Convertible auf Index-Basket	USD	1'000.00	10.06.2015	12.06.2017	28 458 405		-	98.139	100.000		0.000	Y
2.13 % (pro rata) Reverse Convertible on Indices Called for red.on 15.03.17 at 100% 15.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	15.06.2016	15.06.2017	32 872 106		-	100.000	100.000	15.03.	0.000	N
1.9 % Reverse Convertible auf Aktien 23.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	20.07.2016	20.07.2017	33 202 669		-	100.000	100.000	23.01.	0.000	N
9 % Reverse Convertible on Equities Series N8535	CHF	1'000.00	27.07.2016	27.07.2017	33 292 358		-	100.000	100.000	27.07.	0.000	Y
10 % Reverse Convertible auf Aktien-Basket	EUR	1'000.00	18.02.2016	18.08.2017	31 437 608		-	100.000	100.000	18.08.	0.000	Y
Capital Guaranteed Basket on a Basket of Indices Series N872	EUR	1'000.00	21.08.2012	21.08.2017	19 226 229		-	94.919	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible on Equities Series N8851	EUR	1'000.00	01.09.2016	01.09.2017	33 697 144		-	100.000	100.000	01.09.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities Series N7850	CHF	1'000.00	11.04.2016	09.10.2017	32 057 095		-	100.000	100.000		0.000	Y
3/4 % (9 % p.a.) Reverse Convertible auf Aktien 13.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	12.10.2016	12.10.2017	34 216 126		-	100.000	100.000	14.01. 14.02.	0.000 0.000	N
11 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	19.10.2016	19.10.2017	34 201 805		-	100.000	100.000	19.10.	0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities Series N7917	CHF	1'000.00	22.04.2016	23.10.2017	32 229 237		-	100.000	100.000	24.04. 23.10.	0.000 0.000	N
10 % Reverse Convertible on Equities Series N9633	USD	1'000.00	14.11.2016	14.11.2017	34 468 172		-	100.000	100.000	14.11.	15.960	Y
10 % Reverse Convertible on Equities Series N9948	USD	1'000.00	07.12.2016	07.12.2017	34 778 579		-	100.000	100.000	07.12.	16.330	Y
0.82 % (pro rata) Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	15.12.2016	08.12.2017	34 863 108		-	100.000	100.000	10.01. 10.02. 08.03.	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	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
7.1 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	14.12.2016	14.12.2017	32 890 232		-	100.000	100.000	14.12.	3.000	Y
3.5 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	29.12.2016	22.12.2017	35 065 820		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
3 % Reverse Convertible auf Indizes	CHF	1'000.00	29.12.2016	22.12.2017	35 066 314		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
3 % Reverse Convertible auf Indizes	EUR	1'000.00	29.12.2016	22.12.2017	35 066 410		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
Leveraged Participation Note auf Euro Stoxx 50-Index	EUR	1'000.00	19.02.2013	15.02.2018	20 713 392	%	161.680	94.744	100.000		0.000	Y
5.1 % Structured Notes on BSKT Series N7769	CHF	1'000.00	10.03.2016	12.03.2018	31 825 407	%	102.800	100.000	100.000	10.03.	0.000	N
Note auf Aktien-Basket 25.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.951%	EUR	1'000.00	24.07.2015	24.07.2018	28 976 614		-	99.482	100.000		0.000	Y
0.67 % Reverse Convertible auf Aktien 26.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	26.07.2016	26.07.2018	33 361 633		-	100.000	100.000	26.01. 26.02. 26.03. 26.04. 26.05.	0.60753 0.60728 0.55013 0.61561 0.60005	N
Reverse Convertible auf Aktien 27.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	27.07.2016	27.07.2018	33 289 433		-	100.000	100.000		0.000	Y
6.5 % Reverse Convertible on Salzgitter I	CHF	1'000.00	21.08.2017	21.08.2018	37 925 257	%	100.000	100.000	100.000		0.000	Y
Memory Express Return-Zert. auf N.-Akt. BASF 11.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.925%	EUR	1'000.00	10.09.2014	10.09.2018	25 265 290		-	98.542	100.000		0.000	Y
2.5 % Reverse Convertible on Equities Series N8990	CHF	1'000.00	09.09.2016	11.09.2018	33 825 205	%	93.610	100.000	100.000		0.000	N
Quanto Equity Linked Note on a Basket of Shs Series N2602	USD	1'000.00	28.10.2013	29.10.2018	22 675 247	%	97.470	92.762	100.000		0.000	Y
4 % Express-Aktienanl. auf Euro Stoxx 50-Index 30.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	29.10.2015	29.10.2018	30 070 864		-	100.000	100.000	30.10.	0.49384	N
0.65 % (pro rata) Reverse Convertible auf Aktien Ser N12290 6.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	06.06.2017	07.12.2018	28 531 787		-	100.000	100.000	07.08. 06.09.	0.000 0.000	N
3 % Reverse Convertible on Equities Series N10093	CHF	1'000.00	16.12.2016	14.12.2018	34 947 033	%	107.990	100.000	100.000	15.12.	0.000	N
Colibri Em 8810 mit Kreditrisiko auf Lafarge var.	CHF	5'000.00	04.10.2013	27.12.2018	22 423 417	%	100.690	100.000	100.000	27.03. 27.06. 27.09. 27.12.	21.760 22.310 22.300 22.110	N
Notes auf Basket	USD	1'000.00	27.01.2014	28.01.2019	23 479 544	%	111.350	91.745	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities Series N7824 28.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	29.03.2016	07.05.2019	32 007 447		-	100.000	100.000		0.000	Y
0.42 % (pro rata) Reverse Convertible auf Aktien Ser N11799	EUR	1'000.00	09.05.2017	09.05.2019	36 569 620		n.v.	100.000	100.000	08.06. 08.07. 08.08. 08.09. 08.10. 08.11. 08.12.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
Memory-Express-Zert. auf BMW	EUR	1'000.00	20.05.2015	20.05.2019	27 972 079	CHF	1118.600	98.804	100.000		0.000	Y
Autocall Note on a Bskt of Indices &Fund	USD	1'000.00	01.08.2014	01.08.2019	24 807 950	%	90.050	91.430	100.000		0.000	Y
Autocall Note on a Bskt of Shs Series N4468	USD	1'000.00	30.09.2014	30.09.2019	25 485 978	%	96.550	90.880	100.000		0.000	Y
0.47 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.10.2017	18.10.2019	38 584 617	%	90.390	100.000	100.000	20.11. 20.12.	0.000 0.000	N
Memory Express Return-Zert. auf Orange	EUR	1'000.00	12.11.2015	12.11.2019	30 179 231	CHF	1177.960	99.407	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices Series N9681 16.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	22.11.2016	18.11.2019	34 508 453		-	100.000	100.000		0.000	N
Digital Note	EUR	1'000.00	23.11.2015	25.11.2019	30 475 493	%	94.420	99.853	100.000		0.000	Y
Capital Protected Note on a Basket of Indices & Fd	EUR	1'000.00	17.12.2014	17.12.2019	26 306 863	%	96.250	98.044	100.000		0.000	Y
Structured Notes VRN on a Bskt of Index Series N6702	CHF	1'000.00	11.08.2015	11.08.2020	29 096 850	%	95.040	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Structured Notes VRN on a Basket of Indices 3.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	02.10.2015	02.10.2020	29 768 034		-	100.000	100.000		0.000	Y
Structured Notes on Swiss Market Ix Series N7435	USD	1'000.00	24.12.2015	24.12.2020	30 771 007	%	97.390	91.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices Series N7899	CHF	1'000.00	19.04.2016	20.04.2021	32 178 102	%	95.980	71.000	100.000	19.01. 21.04. 19.07. 19.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible on a Equities Series N7974	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.05.2021	32 365 163	%	29.940	100.000	100.000		0.000	Y
Capital Protected Note auf Index-Basket	EUR	1'000.00	05.11.2014	08.11.2021	25 817 211	%	101.910	95.412	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices Series N9156 12.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	12.10.2016	12.10.2022	33 981 860		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices Ser N10043 15.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	15.12.2016	15.12.2022	33 242 582		-	100.000	100.000	15.03.	4.990	N
Reverse Convertible on Indices Series N10154 30.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.12.2016	30.12.2022	35 027 296		-	100.000	100.000	30.03. 30.03.	12.400 0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 22.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	100'000.00	22.03.2017	22.03.2023	35 973 028		-	100.000	100.000	22.06.	537.14	N
Reverse Convertible Indices Called for red.on 18.09.17 at 100% 18.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	31.05.2017	16.06.2023	36 870 053		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices Series N12211 18.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	31.05.2017	16.06.2023	36 869 675		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices Series N12181 22.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	31.05.2017	22.06.2023	36 851 875		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 5.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	09.06.2017	05.07.2023	33 242 623		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 4.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	14.08.2017	01.09.2023	33 242 644		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 4.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	14.08.2017	01.09.2023	33 242 643		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 26.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	05.09.2017	25.09.2023	33 242 649		-	100.000	100.000	26.12.	4.675	N
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	04.10.2017	25.10.2023	33 242 661	%	100.020	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-08.09.17 on	CHF	1'000.00	05.10.2017	26.10.2023	33 242 659	%	99.930	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	09.10.2017	30.10.2023	33 242 613	%	99.480	100.000	100.000		0.000	Y
Cooperatieve Rabobank U.A., Utrecht, Niederlande												
Wereld Note 2009-13.1.17 on a Basket of Indices and Funds	EUR	100.00	13.01.2010	13.01.2017	10 826 406		-	80.965	100.000		0.000	Y
Notes on Robeco Structured Finance Ref Entity Reg-S	EUR	1'000.00	08.07.2008	08.07.2018	4 256 098	%	99.200	61.996	100.000		0.000	Y
Euro Medium-Term Notes on Transtrend Ref Portfolio III Reg-S S3274 Sr	EUR	1'000.00	28.05.2009	28.05.2019	10 136 977	%	96.750	69.235	100.000		0.000	Y
Credit Agricole CIB Finance (Guernsey) Limited, St Peter Port, Guernsey												
(2 1/2 % min./6 1/2 % max.) Floored and Capped Floater Floating Rate Reg-S Senior	EUR	1'000.00	12.02.2010	12.02.2017	10 922 948		-	100.000	100.000	12.02.	6.662	N
Fix to Floating Rate Note Variable Rate Senior	NOK	10'000.00	30.11.2012	30.11.2017	13 096 087		-	100.000	100.000	28.02. 30.05. 30.08. 30.11.	4.364 4.131 3.817 3.346	N
CREDIT AGRICOLE CIB FINANCIAL SOLUTIONS, Courbevoie, Frankreich												
(0 % min.) Credit Linked Note FRN Credit Linked on Generali Fin BV Ref Entity	CHF	10'000.00	25.02.2014	30.03.2019	20 099 165	%	100.150	100.000	100.000	30.03. 30.06. 30.09. 30.12.	14.170 14.190 14.245 14.350	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
(1.6 % min./4 1/2 % max.) Collared Floating Rate Notes Floating Rate	USD	1'000.00	19.12.2014	19.12.2019	25 273 808	%	98.700	100.000	100.000	19.03.	3.986	N
										19.06.	3.895	
										19.09.	3.851	
										19.12.	3.949	
Credit Industriel et Commercial SA, Paris, Frankreich												
(2.7 % min./6 % max.) Credit Linked Notes FRN Cr Lkd on AXA S.A. Reference Ent Srs 414	EUR	100'000.00	20.06.2013	20.06.2018	21 556 095	%	99.690	100.000	100.000	20.03.	723.43	N
										20.06.	732.94	
										20.09.	778.81	
										20.12.	789.78	
Credit Suisse AG, London Branch, London, Grossbritannien												
SPIRIT ProNote on SMI-Index	CHF	1'000.00	10.01.2012	10.01.2017	14 073 664		-	96.420	99.000		0.000	Y
(1.1 % min./4 % max.)Capped Floored Floating Notes Floating Rate	CHF	1'000.00	10.01.2012	10.01.2017	14 637 872		-	100.000	100.000	10.01.	2.811	N
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	12.01.2016	12.01.2017	30 615 453		-	100.000	100.000	12.01.	0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.01.2016	12.01.2017	29 796 754		-	100.000	100.000	12.01.	4.082	N
ProNote on Zurich Finl SvcsN	CHF	1'000.00	17.01.2012	17.01.2017	14 073 732		-	97.570	100.000		0.000	Y
7 1/4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.07.2015	17.01.2017	27 822 538		-	100.000	100.000	17.01.	3.258	N
13.03 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.01.2016	17.01.2017	30 615 577		-	100.000	100.000	17.01.	4.010	N
4.69 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.01.2016	18.01.2017	30 615 620		-	100.000	100.000	18.01.	0.000	N
7.98 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.01.2016	18.01.2017	30 615 621		-	100.000	100.000	18.01.	0.000	N
5.4 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.10.2015	19.01.2017	29 557 484		-	100.000	100.000	19.01.	0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.01.2016	19.01.2017	29 796 758		-	100.000	100.000	19.01.	3.992	N
11.46 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.01.2016	19.01.2017	30 615 651		-	100.000	79.873	19.01.	0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.01.2016	19.01.2017	29 796 762		-	100.000	100.000	19.01.	0.000	N
10.83 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.01.2016	19.01.2017	30 615 655		-	100.000	100.000	19.01.	0.000	N
6.05 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.01.2016	23.01.2017	30 615 754		-	100.000	100.000	23.01.	0.000	N
11.3 % Top Brands Basket on Aktien-Basket	EUR	1'000.00	26.01.2016	26.01.2017	29 267 210		-	100.000	100.000	26.01.	0.160	Y
12.3 % Europa Blue Chip Basket on Shares-Basket	EUR	1'000.00	26.01.2016	26.01.2017	29 267 211		-	100.000	100.000	26.01.	0.160	Y
7.83 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	28.07.2015	30.01.2017	28 229 762		-	100.000	100.000	30.01.	0.000	N
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	28.01.2016	30.01.2017	30 615 920		-	100.000	100.000	30.01.	0.000	N
4 1/2 % Reverse Convertible on DAX	EUR	1'000.00	28.01.2016	30.01.2017	30 615 921		-	100.000	100.000	30.01.	0.000	N
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	31.07.2015	31.01.2017	27 822 547		-	100.000	100.000	31.01.	0.000	N
Phoenix Plus VRN on a Basket of Indices	USD	1'000.00	30.01.2014	01.02.2017	22 882 193		-	100.000	100.000	01.02.	32.746	N
5 % Reverse Convertible on Kellogg	USD	1'000.00	01.02.2016	01.02.2017	30 616 000		-	100.000	100.000	01.02.	3.622	N
5 % Reverse Convertible on Pfizer	USD	1'000.00	01.02.2016	01.02.2017	30 615 998		-	100.000	100.000	01.02.	3.622	N
5 % Reverse Convertible on Fedex	USD	1'000.00	01.02.2016	01.02.2017	30 616 001		-	100.000	100.000	01.02.	3.622	N
5 % Reverse Convertible on Syngenta N	CHF	1'000.00	01.02.2016	01.02.2017	30 616 004		-	100.000	100.000	01.02.	0.000	N
5 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	01.02.2016	01.02.2017	30 616 005		-	100.000	100.000	01.02.	0.000	N
5 % Reverse Convertible on Nestle N	CHF	1'000.00	01.02.2016	01.02.2017	30 616 002		-	100.000	100.000	01.02.	0.000	N
5 % Reverse Convertible on Novartis N	CHF	1'000.00	01.02.2016	01.02.2017	30 616 003		-	100.000	100.000	01.02.	0.000	N
(2.6 % min./6 % max.) Capped Floored Floating Notes Floating Rate	USD	1'000.00	02.02.2012	02.02.2017	14 546 387		-	100.000	100.000	02.02.	6.573	N
(1.3 % min./4 % max.) Capped Floored Floater Floating Rate	CHF	1'000.00	02.02.2012	02.02.2017	14 546 403		-	100.000	100.000	02.02.	3.322	N
7 1/4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.02.2016	02.02.2017	29 796 768		-	100.000	100.000	02.02.	3.610	N
7.45 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	03.02.2016	03.02.2017	30 616 047		-	100.000	100.000	03.02.	0.000	N
5.82 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.02.2016	03.02.2017	30 616 049		-	100.000	100.000	03.02.	0.000	N
8.09 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.02.2016	03.02.2017	30 616 046		-	100.000	100.000	03.02.	0.000	N
Reverse Convertible on Commodities	USD	1'000.00	04.02.2015	06.02.2017	26 574 189		-	98.500	100.000		0.000	Y
Bonus-Cert. on Euro Stoxx 50-Index	EUR	100.00	03.02.2011	07.02.2017	12 212 399		-	83.665	100.000		0.000	Y
Express Certificates with Memory Payout on Banco Santander	EUR	1'000.00	07.02.2014	07.02.2017	20 970 547		-	98.080	100.000		0.000	Y
4 3/4 % SPIRIT WoBRC on Indices	EUR	1'000.00	11.02.2014	13.02.2017	23 543 394		-	100.000	100.000	13.02.	3.357	N
8 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.02.2016	15.02.2017	29 796 775		-	100.000	100.000	15.02.	0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.08.2015	20.02.2017	27 822 559		-	100.000	100.000	20.02.	0.000	N
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.08.2015	20.02.2017	28 887 224		-	100.000	100.000	20.02.	0.000	N
12.4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.02.2016	23.02.2017	31 336 690		-	100.000	100.000	23.02.	3.520	N
11.04 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.02.2016	23.02.2017	31 336 692		-	100.000	100.000	23.02.	0.000	N
(1.15 % min./4 % max.) Capped Floored Floater Floating Rate	CHF	1'000.00	24.02.2011	24.02.2017	12 299 896		-	100.000	100.000	24.02.	2.938	N
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.02.2015	24.02.2017	20 214 981		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
(1 % min./4 % max.) Capped Floored Floating Notes Floating Rate	CHF	1'000.00	01.03.2012	01.03.2017	14 780 261		-	100.000	100.000	01.03.	2.500	N
(2 1/2 % min./6 % max.) Capped Floored Floater Floating Rate	USD	1'000.00	01.03.2012	01.03.2017	14 795 386		-	100.000	100.000	01.03.	6.305	N
(1.35 % min./3 1/4 % max.) Capped Floored Floater Floating Rate	CHF	1'000.00	02.03.2012	02.03.2017	14 927 072		-	100.000	100.000	02.03.	3.375	N
Garant Anleihe on Index-Basket	EUR	1'000.00	24.02.2011	03.03.2017	12 224 145		-	83.563	100.000		0.000	Y
6.35 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.03.2016	07.03.2017	31 336 917		-	100.000	100.000	07.03.	0.000	N
10.53 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	08.03.2016	08.03.2017	31 336 923		-	100.000	100.000	08.03.	0.000	N
6.64 % Reverse Convertible on Givaudan N	CHF	1'000.00	09.03.2016	09.03.2017	31 336 949		-	100.000	100.000	09.03.	0.000	N
4.89 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.09.2016	13.03.2017	33 471 807		-	100.000	100.000	13.03.	0.000	N
15.68 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.03.2016	14.03.2017	31 337 035		-	100.000	100.000	14.03.	0.000	N
8 1/2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.03.2016	14.03.2017	29 796 789		-	100.000	100.000	14.03.	0.000	N
11.92 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.03.2016	16.03.2017	31 337 071		-	100.000	100.000	16.03.	0.000	N
1.50 % p.a. Coupon Bonus Certificates on Euro Stoxx 50	EUR	1'000.00	17.03.2011	17.03.2017	12 448 569		-	91.050	100.000	17.03.	16.080	Y
1.30 % p.a. Coupon Bonus Certificates on Euro Stoxx 50	USD	1'000.00	17.03.2011	17.03.2017	12 448 570		-	91.510	100.000	17.03.	12.970	Y
Outperformance Bonus Certificates on Euro Stoxx 50	EUR	1'000.00	17.03.2011	17.03.2017	12 448 289		-	82.970	100.000		0.000	Y
Outperformance Bonus Certificates on Euro Stoxx 50	USD	1'000.00	17.03.2011	17.03.2017	12 448 290		-	84.430	100.000		0.000	Y
Floored Barrier Reverse Convertibles on Euro Stoxx 50	USD	1'000.00	17.03.2011	17.03.2017	12 448 568		-	100.000	100.000	17.03.	2.422	N
Floored Barrier Reverse Convertibles on Euro Stoxx 50	CHF	1'000.00	17.03.2011	17.03.2017	12 448 567		-	100.000	100.000	17.03.	0.000	N
14 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.03.2016	21.03.2017	29 796 793		-	100.000	100.000	21.03.	4.172	N
1 1/4 % on Shares-Basket 3.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	AUD	1'000.00	27.03.2015	27.03.2017	27 224 054		-	96.000	100.000		0.000	Y
(2.15 % - 2.95 %) Step-Up Coupon Note Step-Up	USD	1'000.00	28.03.2012	28.03.2017	14 997 474		-	100.000	100.000	28.03.	14.507	N
Outperformance Bonus Certificates on Euro Stoxx 50	USD	1'000.00	29.03.2011	29.03.2017	12 675 603		-	85.680	100.000		0.000	Y
Outperformance Bonus Certificates (24.3.17) on the Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	31.03.2011	31.03.2017	12 448 300		-	85.280	100.000		0.000	Y
Floored Barrier Reverse Convertible on EURO STOXX 50	CHF	1'000.00	31.03.2011	31.03.2017	12 448 303		-	100.000	100.000	03.01. 31.03.	0.000 0.000	N
1.30 Bonus Certificate on EURO STOXX 50	USD	1'000.00	31.03.2011	31.03.2017	12 448 302		-	93.490	100.000	31.03.	13.010	Y
Floored Barrier Reverse Convertibles on Euro Stoxx 50	EUR	1'000.00	31.03.2011	31.03.2017	12 448 304		-	100.000	100.000	02.01. 31.03.	0.000 0.000	N
Bonus Certificates with 1 1/2 % Coupon on Euro Stoxx 50	EUR	1'000.00	31.03.2011	31.03.2017	12 448 301		-	91.210	100.000	31.03.	16.050	Y
Outperformance Bonus Certificates on the Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	31.03.2011	31.03.2017	12 448 299		-	83.120	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	31.03.2015	31.03.2017	27 510 981		-	93.830	94.000		0.000	Y
8 1/4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.04.2016	12.04.2017	31 337 423		-	100.000	100.000	12.04.	3.667	N
5 1/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.10.2015	19.04.2017	29 557 478		-	100.000	100.000	19.04.	0.000	N
7 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.10.2015	20.04.2017	29 557 494		-	100.000	100.000	20.04.	0.000	N
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	21.10.2015	21.04.2017	27 257 067		-	99.150	100.000		0.000	Y
12.9 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.10.2015	24.04.2017	29 557 567		-	100.000	100.000	24.04.	0.000	N
8.27 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.10.2015	24.04.2017	29 557 563		-	100.000	100.000	24.04.	0.000	N
13.27 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.04.2016	25.04.2017	32 047 332		-	100.000	100.000	25.04.	0.000	N
(0.85 % min./4 % max.) Capped Floored Floater Floating Rate	CHF	1'000.00	27.04.2012	27.04.2017	18 187 240		-	100.000	100.000	27.01. 27.04.	2.172 2.125	N
(1.1 % min./4 % max.) Capped Floored Floater Floating Rate Series SPLB2011-246	CHF	1'000.00	28.04.2011	28.04.2017	12 707 150		-	100.000	100.000	30.01. 28.04.	2.872 2.688	N
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.07.2015	28.04.2017	28 886 908		-	100.000	100.000	30.01. 28.04.	0.000 0.000	N
4 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.11.2015	03.05.2017	29 557 738		-	100.000	100.000	03.05.	0.000	N
3 % Barrier Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	09.05.2014	09.05.2017	20 214 802		-	100.000	100.000	09.05.	0.750	N
3.52 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	12.05.2015	12.05.2017	27 511 664		-	100.000	100.000	12.05.	0.000	N
12 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.05.2016	17.05.2017	29 796 820		-	100.000	100.000	17.05.	3.671	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.11.2015	18.05.2017	30 234 102		-	100.000	100.000	18.05.	0.000	N
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.05.2015	22.05.2017	23 996 005		-	100.000	100.000	22.05.	0.000	N
(0.7 % min./4 % max.) Capped Floored Floater Floating Rate	CHF	1'000.00	24.05.2012	24.05.2017	18 387 189		-	100.000	100.000	24.02. 24.05.	1.788 1.730	N
7.9 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.05.2016	24.05.2017	32 047 740		-	100.000	100.000	24.05.	0.000	N
6 1/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.05.2015	26.05.2017	23 996 006		-	100.000	100.000	26.05.	0.000	N
7.48 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	25.05.2016	26.05.2017	32 047 770		-	100.000	100.000	26.05.	0.000	N
10.96 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.05.2016	29.05.2017	32 047 844		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	01.12.2015	01.06.2017	27 822 627		-	100.000	100.000	01.06.	0.000	N
4.38 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.12.2016	02.06.2017	34 689 997		-	100.000	100.000	02.03. 02.06.	0.000 0.000	N
8.64 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.06.2016	05.06.2017	32 047 956		-	100.000	100.000	05.06.	0.000	N
Drop-Back Tracker Certificates on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	06.06.2014	06.06.2017	24 334 949		-	98.630	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.12.2015	06.06.2017	30 234 301		-	100.000	100.000	06.06.	0.000	N
7.8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.12.2015	08.06.2017	30 234 354		-	100.000	100.000	08.06.	0.000	N
10 1/2 % Reverse Convertible on Tesla Motors	USD	1'000.00	08.06.2016	08.06.2017	29 796 833		-	100.000	100.000	08.06.	4.207	N
7 1/4 % Reverse Convertible on Axa	EUR	1'000.00	08.06.2016	08.06.2017	29 796 834		-	100.000	100.000	08.06.	0.000	N
6.8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	09.12.2015	09.06.2017	30 234 366		-	100.000	100.000	09.06.	0.000	N
ProNote with Capped Participation on SMI	CHF	1'000.00	12.04.2013	12.06.2017	20 889 109		-	88.850	90.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	14.06.2016	14.06.2017	32 048 123		-	100.000	100.000	14.06.	0.000	N
6 3/4 % Reverse Convertible on Adecco Group N	CHF	1'000.00	14.06.2016	14.06.2017	32 048 124		-	100.000	100.000	14.06.	0.000	N
4 1/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.06.2015	19.06.2017	23 996 025		-	100.000	100.000	19.06.	0.000	N
6.74 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	20.06.2016	20.06.2017	32 776 953		-	100.000	100.000	20.06.	0.000	N
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	1'000.00	24.12.2014	26.06.2017	25 726 791		-	99.999	100.000		0.000	Y
(1.7 % - 2 1/2 %) Step-Up Coupon Note Step-Up	USD	1'000.00	27.06.2012	27.06.2017	18 574 000		-	100.000	100.000	27.06.	12.061	N
(1 % min./5 % max.) Capped Floored Floater Floating Rate	CHF	1'000.00	30.06.2011	30.06.2017	13 007 846		-	100.000	100.000	30.03. 30.06.	2.500 2.555	N
4 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.06.2015	30.06.2017	28 229 367		-	100.000	100.000	30.06.	0.000	N
ProNote on E.ON N	EUR	1'000.00	02.07.2012	03.07.2017	18 759 803		-	93.850	100.000		0.000	Y
ProNote on Swisscom N	CHF	1'000.00	03.07.2012	03.07.2017	18 759 821		-	98.270	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.07.2015	03.07.2017	28 229 442		-	100.000	100.000	03.01. 03.07.	0.000 0.000	N
7.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.07.2016	04.07.2017	32 777 242		-	100.000	100.000	04.01. 04.07.	0.000 0.000	N
7.6 % Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	04.01.2016	05.07.2017	30 615 355		-	100.000	100.000	04.01. 05.07.	5.016 4.733	N
14 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.07.2016	06.07.2017	32 777 294		-	100.000	100.000	06.01. 06.07.	0.000 0.000	N
ProNote on Unilever Cert	EUR	1'000.00	09.07.2012	10.07.2017	18 759 884		-	94.060	100.000		0.000	Y
ProNote on Unilever Cert	EUR	1'000.00	09.07.2012	10.07.2017	18 759 883		-	94.060	100.000		0.000	Y
ProNote on Zurich Insur GrpN	CHF	1'000.00	11.07.2012	11.07.2017	18 759 930		-	95.450	97.000		0.000	Y
ProNote on Unilever Cert	EUR	1'000.00	11.07.2012	11.07.2017	18 759 929		-	91.610	97.000		0.000	Y
7.45 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	14.07.2016	14.07.2017	32 777 391		-	100.000	100.000	16.01. 14.07.	0.000 0.000	N
6.89 % Reverse Convertible on Adecco Group N	CHF	1'000.00	18.07.2016	18.07.2017	32 777 432		-	100.000	100.000	18.01. 18.07.	0.000 0.000	N
9.16 % Reverse Convertible on Adecco Group N	CHF	1'000.00	18.07.2016	18.07.2017	32 777 430		-	100.000	100.000	18.01. 18.07.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.07.2015	24.07.2017	28 229 646		-	98.260	100.000		0.000	Y
6.3 % Reverse Convertible on Adecco Group N	CHF	1'000.00	27.04.2017	27.07.2017	36 211 523		-	100.000	100.000	27.07.	0.000	Y
8.94 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	04.08.2016	04.08.2017	32 777 662		-	100.000	100.000	06.02. 04.08.	0.000 0.000	N
4.3 % Reverse Convertible on Equities 13.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	10.08.2015	10.08.2017	28 887 056		-	100.000	100.000	10.02.	0.000	N
9.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.02.2016	15.08.2017	31 336 526		-	100.000	100.000	15.02. 15.08.	0.000 0.000	N
10.05 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.08.2016	15.08.2017	32 777 812		-	100.000	100.000	15.02. 15.08.	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	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
6.7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.08.2016	16.08.2017	32 777 826		-	100.000	100.000	16.02. 16.08.	0.000 0.000	N
3 % Reverse Convertible on Equities 16.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.08.2015	18.08.2017	28 887 236		-	100.000	100.000	20.02. 16.03.	0.000 0.000	N
5.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.08.2016	18.08.2017	32 777 845		-	100.000	100.000	20.02. 18.08.	0.000 0.000	N
22.53 % Reverse Convertible on Snap-A Rg	USD	1'000.00	18.05.2017	18.08.2017	36 211 876		-	100.000	100.000	18.08.	2.830	Y
13.26 % Reverse Convertible on Dow Chemical Rg	USD	1'000.00	19.05.2017	21.08.2017	36 211 898		-	100.000	100.000	21.08.	2.910	Y
11.65 % Reverse Convertible on Gilead Sciences Rg	USD	1'000.00	19.05.2017	21.08.2017	36 211 901		-	100.000	100.000	21.08.	2.910	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	22.05.2017	22.08.2017	36 211 908		-	100.000	100.000	22.08.	0.000	Y
7.1 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	22.05.2017	22.08.2017	36 211 915		-	100.000	100.000	22.08.	0.000	Y
7.54 % Reverse Convertible on Schlumberger Rg	USD	1'000.00	23.05.2017	23.08.2017	36 211 941		-	100.000	100.000	23.08.	2.840	Y
5.5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.05.2017	23.08.2017	36 211 924		-	100.000	100.000	23.08.	0.000	Y
9 % Reverse Convertible on iShs MSCI Br Cp	USD	1'000.00	23.05.2017	23.08.2017	36 211 951		-	100.000	100.000	23.08.	2.840	Y
8.28 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.05.2017	23.08.2017	36 211 934		-	100.000	100.000	23.08.	0.000	Y
4.1 % Reverse Convertible on General Electric Rg	USD	1'000.00	23.05.2017	23.08.2017	36 211 952		-	100.000	100.000	23.08.	2.840	Y
6.6 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.08.2016	28.08.2017	33 471 607		-	100.000	100.000	27.02. 28.08.	0.000 0.000	N
8 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.08.2016	28.08.2017	31 883 964		-	100.000	100.000	27.02. 28.08.	4.625 4.393	N
ProNote on Gold	USD	1'000.00	29.08.2014	29.08.2017	25 126 763		-	92.820	96.000		0.000	Y
(1.65 % min./6 % max.) Capped Floored Floater Notes Floating Rate	USD	1'000.00	30.08.2012	30.08.2017	19 014 266		-	100.000	100.000	28.02. 30.05. 30.08.	4.131 4.067 4.044	N
5 1/2 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	01.03.2016	01.09.2017	31 336 830		-	100.000	100.000	01.03. 01.09.	0.000 0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	03.06.2016	04.09.2017	29 796 829		-	100.000	100.000	03.03. 06.06. 04.09.	0.000 0.000 0.000	N
ProNote on S&P 500	USD	1'000.00	05.09.2014	05.09.2017	25 233 549		-	86.860	90.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.03.2016	07.09.2017	29 796 785		-	100.000	100.000	07.03. 07.09.	0.000 0.000	N
ProNote on S&P 500	USD	1'000.00	10.09.2014	11.09.2017	25 233 628		-	86.860	90.000		0.000	Y
8.85 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.09.2016	13.09.2017	31 883 978		-	100.000	100.000	13.03. 13.09.	0.000 0.000	N
7 1/2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.09.2016	14.09.2017	31 883 972		-	100.000	100.000	14.03. 14.09.	0.000 0.000	N
Capital Protected Note on CS ARB US Index	USD	200'000.00	25.09.2012	18.09.2017	19 507 575		-	91.210	95.000		0.000	Y
5.74 % Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	16.09.2016	18.09.2017	33 471 926		-	100.000	100.000	16.03. 18.09.	0.000 0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.09.2016	20.09.2017	33 471 964		-	100.000	100.000	20.03. 20.09.	0.000 0.000	N
8.6 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.03.2016	21.09.2017	31 337 155		-	100.000	100.000	21.03. 21.09.	0.000 0.000	N
10.78 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.09.2016	21.09.2017	33 471 982		-	100.000	100.000	21.03. 21.09.	0.000 0.000	N
8 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.09.2016	25.09.2017	31 883 979		-	100.000	100.000	23.03. 23.09.	4.714 4.603	N
4 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.09.2016	25.09.2017	33 472 041		-	100.000	100.000	23.03. 25.09.	0.000 0.000	N
9.23 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.09.2016	26.09.2017	33 472 063		-	100.000	100.000	27.03. 26.09.	0.000 0.000	N
5 1/2 % Reverse Convertible on Adecco Group N	CHF	1'000.00	28.09.2016	28.09.2017	33 472 123		-	100.000	100.000	28.03. 28.09.	0.000 0.000	N
9 % Reverse Convertible on CS Group N	CHF	1'000.00	28.09.2016	28.09.2017	33 472 124		-	100.000	100.000	28.03. 28.09.	0.000 0.000	N
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.10.2016	03.10.2017	31 883 982		-	100.000	100.000	03.04. 03.10.	0.000 0.000	N
6 1/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	05.10.2016	05.10.2017	33 472 325		-	100.000	100.000	05.04. 05.10.	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	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
7.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	05.10.2016	05.10.2017	33 472 324		-	100.000	100.000	05.04. 05.10.	0.000 0.000	N
6 1/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	12.10.2016	12.10.2017	33 472 479		-	100.000	100.000	12.04. 12.10.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	13.10.2015	13.10.2017	27 257 066		-	98.560	100.000		0.000	Y
7.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.10.2016	18.10.2017	31 883 992		-	100.000	100.000	18.04. 18.10.	0.000 0.000	N
5.29 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.10.2015	23.10.2017	29 557 547		-	100.000	100.000	24.04. 23.10.	0.000 0.000	N
5.13 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.10.2015	23.10.2017	29 557 548		-	100.000	100.000	24.04. 23.10.	0.000 0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.10.2016	24.10.2017	34 150 491		-	100.000	100.000	24.04. 24.10.	0.000 0.000	N
8 3/4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.10.2016	24.10.2017	34 150 505		-	100.000	100.000	24.04. 24.10.	4.728 4.701	N
7 1/2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.10.2016	25.10.2017	31 883 988		-	100.000	100.000	25.04. 25.10.	0.000 0.000	N
14.2 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.10.2016	30.10.2017	34 150 644		-	100.000	100.000	28.04. 30.10.	4.927 4.935	N
ProNote on SMI	CHF	1'000.00	02.11.2012	02.11.2017	19 777 539		-	88.720	90.000		0.000	Y
8.5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.11.2016	09.11.2017	31 883 999		-	100.000	100.000	09.05. 09.11.	4.825 4.791	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.05.2016	10.11.2017	32 047 521		-	100.000	100.000	10.05. 10.11.	0.000 0.000	N
8.00 % Reverse Convertible on Total	EUR	1'000.00	11.11.2016	13.11.2017	34 150 910		-	100.000	100.000	11.05. 13.11.	0.000 0.000	N
Protection Participation on S&P 500	USD	1'000.00	18.11.2014	20.11.2017	25 833 231		-	86.940	90.000		0.000	Y
12.75 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.05.2016	24.11.2017	29 796 821		-	100.000	100.000	24.05. 24.11.	4.541 4.552	N
5 % Reverse Convertible on Linde	EUR	1'000.00	24.11.2016	24.11.2017	34 151 196		-	100.000	100.000	24.05. 24.11.	0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible on Lvmh	EUR	1'000.00	24.11.2016	24.11.2017	34 151 197		-	100.000	100.000	24.05. 24.11.	0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible on Sanofi	EUR	1'000.00	24.11.2016	24.11.2017	34 151 195		-	100.000	100.000	24.05. 24.11.	0.000 0.000	N
Garant-Notes on basket	EUR	1'000.00	19.10.2012	27.11.2017	18 596 500		-	95.055	100.000		0.000	Y
ProNote on SMI	CHF	1'000.00	03.12.2012	04.12.2017	19 777 967		-	88.620	90.000		0.000	Y
8.4 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.12.2016	06.12.2017	34 690 064		-	100.000	100.000	06.06. 06.12.	0.000 0.000	N
5.52 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	09.09.2016	11.12.2017	33 471 788		-	100.000	100.000	09.03. 09.06. 11.09. 11.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
8.1 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.12.2016	14.12.2017	34 690 262		-	100.000	100.000	14.06. 14.12.	0.000 0.000	N
6.15 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.09.2016	22.12.2017	31 883 977		-	100.000	100.000	22.03. 22.06. 22.09. 22.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
12.7 % Reverse Convertible on Intesa Sanpaolo	EUR	1'000.00	22.12.2016	22.12.2017	34 690 376		-	100.000	100.000	22.06. 22.12.	0.000 0.000	N
8.5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.10.2016	16.01.2018	31 883 987	%	100.430	100.000	100.000	13.01. 13.04. 13.07. 13.10.	2.549 2.537 2.443 2.460	N
Outperformance Bonus Certificate on Zurich Insur GrpN	CHF	1'000.00	23.01.2013	23.01.2018	19 036 669	CHF	1674.000	98.020	100.000		0.000	Y
7.5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.01.2017	29.01.2018	31 884 028	%	91.170	100.000	100.000	27.07.	0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.11.2016	02.02.2018	34 150 726	%	100.660	100.000	100.000	02.02. 02.05. 02.08. 02.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
SPIRIT ProNote on S&P 500	USD	1'000.00	03.02.2014	05.02.2018	23 121 238	%	129.820	90.250	95.000		0.000	Y
SPIRIT ProNote on SMI	CHF	1'000.00	12.02.2014	12.02.2018	23 543 450	%	103.850	91.360	92.500		0.000	Y
7.98 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.08.2016	12.02.2018	32 777 778	%	100.470	100.000	100.000	10.02. 10.08.	4.421 4.241	N
8.11 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.08.2016	12.02.2018	32 777 792	%	100.520	100.000	100.000	13.02. 11.08.	4.774 4.573	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
9 % Reverse Convertible on Equities 27.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	15.08.2016	15.02.2018	32 777 806		-	100.000	100.000	15.02. 27.06.	0.000 0.000	N
9.4 % Reverse Convertible on Equities 27.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	15.08.2016	15.02.2018	32 777 807		-	100.000	100.000	15.02. 27.06.	0.000 0.000	N
Protection Participation on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	03.03.2017	05.03.2018	35 783 875	%	96.810	95.240	95.240		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.03.2016	09.03.2018	31 336 960	%	100.690	100.000	100.000	09.03. 11.09.	4.717 4.426	N
Pro Note on CS ARROW Excess Return Index	USD	1'000.00	25.03.2013	16.03.2018	18 135 329	%	102.000	95.100	100.000		0.000	Y
3.15 % (0.7875 %) Equity Index-linked Securities on a Basket of Indices	CHF	1'000.00	07.04.2015	09.04.2018	27 360 961	%	100.560	100.000	100.000	07.01. 07.04. 07.07. 07.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
9 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.04.2017	13.04.2018	31 884 065	%	100.610	100.000	100.000	13.10.	6.772	N
ProNote on CS Systematic Tactical Asset Ix	USD	1'000.00	16.04.2015	16.04.2018	25 775 432	%	95.090	91.930	95.000		0.000	Y
Bonus Certificate on Newmont Mining	USD	1'000.00	22.04.2013	23.04.2018	20 889 119	CHF	1064.120	95.810	100.000		0.000	Y
7.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	25.01.2017	25.04.2018	31 884 027	%	101.280	100.000	100.000	25.04. 25.07. 25.10.	0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker on S & P/ASX 200	USD	1'000.00	07.05.2015	07.05.2018	27 511 325	CHF	1103.100	96.680	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible on Tesla Rg	USD	1'000.00	05.05.2017	07.05.2018	31 884 076	%	99.360	100.000	100.000	06.11.	6.953	N
7.5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.05.2017	10.05.2018	31 884 078	%	100.150	100.000	100.000	10.11.	0.000	N
Underlying Tracker on STXE6O&G EUR P	EUR	1'000.00	01.12.2016	01.06.2018	34 151 281	CHF	1246.200	100.000	100.000		0.000	Y
8.3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.06.2016	07.06.2018	32 047 996	%	103.900	100.000	100.000	07.06. 07.12.	0.000 0.000	N
5.3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.12.2016	07.06.2018	31 884 011	%	102.360	100.000	100.000	07.06. 07.12.	0.000 0.000	N
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.12.2016	19.06.2018	34 690 305	%	100.960	100.000	100.000	19.06. 19.12.	0.000 0.000	N
4.11 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.12.2016	19.06.2018	34 690 304	%	101.020	100.000	100.000	19.06. 19.12.	0.000 0.000	N
7.25 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.03.2017	22.06.2018	31 884 055	%	101.830	100.000	100.000	22.06. 22.09. 22.12.	0.000 0.000 0.000	N
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	28.12.2015	28.06.2018	29 796 752	%	100.730	100.000	100.000	28.12.	0.000	N
7.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	28.12.2016	28.06.2018	31 884 018	%	101.530	100.000	100.000	28.06. 28.12.	0.000 0.000	N
8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.03.2017	29.06.2018	31 884 060	%	100.780	100.000	100.000	30.06. 30.09. 30.12.	0.000 0.000 0.000	N
7.25 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.04.2017	05.07.2018	31 884 061	%	100.290	100.000	100.000	05.07. 05.10.	3.477 3.520	N
6.25 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.07.2016	09.07.2018	32 777 305	%	100.160	100.000	100.000	09.01. 07.07.	3.863 3.665	N
6.3 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.07.2016	09.07.2018	32 777 306	%	101.870	100.000	100.000	09.01. 07.07.	3.863 3.665	N
6.75 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.07.2016	09.07.2018	32 777 304	%	102.150	100.000	100.000	09.01. 07.07.	3.863 3.665	N
Protection Participation on S&P 500	USD	1'000.00	13.07.2017	13.07.2018	37 174 752	%	105.550	93.630	95.000		0.000	Y
SPIRIT ProNote on S&P 500	USD	1'000.00	17.07.2013	17.07.2018	21 546 459	%	136.030	87.840	95.000		0.000	Y
SPIRIT ProNote on S&P 500	USD	1'000.00	18.07.2013	18.07.2018	21 546 479	%	135.710	88.010	95.000		0.000	Y
ProNote with Capped Participation and Coupon on S&P 500-Index	USD	1'000.00	18.07.2013	18.07.2018	20 889 131	%	121.240	94.890	100.000	18.07.	4.760	Y
Protection Participation on IBEX 35	EUR	1'000.00	19.01.2017	19.07.2018	34 690 781	%	98.050	90.000	90.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	19.01.2017	19.07.2018	34 690 782	%	98.220	90.000	90.000		0.000	Y
SPIRIT ProNote on S&P 500	USD	1'000.00	22.07.2013	23.07.2018	21 546 523	%	138.540	88.010	95.000		0.000	Y
SPIRIT ProNote on SMI	CHF	1'000.00	30.07.2013	30.07.2018	21 546 646	%	106.930	94.850	98.310		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	09.02.2017	09.08.2018	31 884 035	%	101.730	100.000	100.000	09.08.	0.000	N
7 % Reverse Convertible on CS Group N	CHF	1'000.00	11.08.2016	13.08.2018	32 777 785	%	104.490	100.000	100.000	13.02. 12.08.	0.000 0.000	N
7 % Reverse Convertible on CS Group N	CHF	1'000.00	12.08.2016	13.08.2018	32 777 805	%	104.500	100.000	100.000	13.02. 14.08.	0.000 0.000	N
3.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.08.2016	22.08.2018	33 471 517	%	100.900	100.000	100.000	22.02. 22.08.	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	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.08.2016	22.08.2018	33 471 516	%	103.260	100.000	100.000	22.02. 22.08.	0.000 0.000	N
ProNote on CS RAII HOLT Relative Value Idx	USD	1'000.00	25.07.2014	28.08.2018	23 717 922	%	93.750	89.320	95.000		0.000	Y
Outperformance Bonus Certificate on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	06.09.2013	07.09.2018	20 681 357	CHF	1675.650	93.420	100.000		0.000	Y
7.25 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.06.2017	13.09.2018	31 884 094	%	98.910	100.000	100.000	13.09. 13.12.	0.000 0.000	N
4.5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.09.2016	21.09.2018	33 471 983	%	103.510	100.000	100.000	21.03. 21.09.	0.000 0.000	N
8.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.06.2017	24.09.2018	31 884 101	%	101.660	100.000	100.000	25.09. 25.12.	0.000 0.000	N
8 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.03.2017	28.09.2018	31 884 058	%	102.520	100.000	100.000	28.09.	7.285	N
8 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.10.2017	09.10.2018	36 656 492	%	79.040	100.000	100.000		0.000	N
3 % Reverse Convertible on Swiss Life Hldg N	CHF	1'000.00	13.10.2016	15.10.2018	33 472 499	%	102.310	100.000	100.000	13.04. 13.10.	0.000 0.000	N
SPIRIT ProNote on S&P 500	USD	1'000.00	24.10.2013	24.10.2018	22 558 216	%	141.940	88.230	95.000		0.000	Y
7.25 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.04.2017	24.10.2018	31 884 067	%	101.350	100.000	100.000	24.10.	0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.11.2016	05.11.2018	33 377 412	%	102.620	97.860	100.000		0.000	Y
6.20 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.11.2016	14.11.2018	34 150 924	%	104.290	100.000	100.000	15.05. 14.11.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on UBS Group N	CHF	1'000.00	26.02.2016	26.11.2018	30 800 031	CHF	817.000	100.000	100.000		0.000	Y
Express Certificates with Memory Payout on HS China Ent Index 27.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.583%	SEK	1'000.00	27.11.2013	27.11.2018	20 970 541		-	90.930	100.000		0.000	Y
Express Certificates with Memory Payout on HS China Ent Index 27.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.79%	EUR	1'000.00	27.11.2013	27.11.2018	20 970 543		-	94.720	100.000		0.000	Y
Outperformance Bonus Certificate on RDX Index USD	USD	1'000.00	04.12.2013	04.12.2018	22 284 612	CHF	766.910	93.100	100.000		0.000	Y
2.5 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	09.12.2015	10.12.2018	30 234 373	%	101.530	100.000	100.000	09.06. 11.12.	0.000 0.000	N
ProNote with Participation on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	16.12.2013	17.12.2018	20 970 544	%	103.300	90.380	95.750		0.000	Y
7.5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.06.2017	17.12.2018	31 884 095	%	97.750	100.000	100.000	15.12.	7.339	N
4.2 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	19.12.2016	19.12.2018	34 690 306	%	102.410	100.000	100.000	19.06. 19.12.	0.000 0.000	N
4.29 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	19.12.2016	19.12.2018	34 690 302	%	102.500	100.000	100.000	19.06. 19.12.	0.000 0.000	N
(3 3/4 % min./6 % max.) Credit Linked Note FRN Crd Lkd on Jaguar Land Rover PLC Ref Ent	USD	10'000.00	25.10.2013	20.12.2018	21 272 131	%	100.260	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	93.436 91.491 90.170 92.314	N
(0 % min.) Credit Linked Floating Rate Note FRN Cr Lkd on Markit iTraxx Europe Index	CHF	1'000.00	31.10.2013	20.12.2018	21 272 289	%	99.980	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	0.903 0.94964 0.94402 0.94539	N
(3 3/4 % min./5 3/4 % max.) Credit Linked Note Cr Lkd on General Electric Capital Corp Ref Ent	AUD	1'000.00	20.11.2013	20.12.2018	21 272 326	%	100.530	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	7.126 6.997 7.275 7.057	N
6.05 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.12.2016	27.12.2018	34 690 424	%	102.490	100.000	100.000	27.06. 27.12.	7.285 7.461	N
SPIRIT ProNote on Zurich Insur GrpN	CHF	1'000.00	17.01.2014	17.01.2019	23 120 825	%	105.040	95.410	98.600		0.000	Y
Reverse Convertible on BANKIA Br	EUR	1'000.00	28.07.2017	28.01.2019	31 884 126	%	97.610	100.000	100.000		0.000	Y
SPIRIT ProNote on S&P 500	USD	1'000.00	03.02.2014	04.02.2019	23 121 237	%	139.370	85.020	92.500		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	09.08.2017	11.02.2019	31 884 129	%	95.890	100.000	100.000		0.000	N
Bonus Certificate on Newmont Mining	USD	1'000.00	12.02.2014	12.02.2019	23 606 368	CHF	1749.180	92.420	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on Newmont Mining	USD	1'000.00	12.02.2014	13.02.2019	23 606 369	CHF	1749.180	92.420	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on Newmont Mining	USD	1'000.00	14.02.2014	14.02.2019	23 606 370	CHF	1740.410	92.460	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5.15 % Reverse Convertible on Indices 13.4.2017 Amortisation 13.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	15.02.2016	15.02.2019	31 336 544		-	100.000	100.000	15.02. 13.04.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on RDX Index USD	USD	1'000.00	02.04.2015	02.04.2019	27 257 055	CHF	1462.680	94.590	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	CHF	1'000.00	09.04.2015	09.04.2019	27 511 081	%	96.030	90.000	90.000		0.000	Y
Protection Participation on STXE S50EURP	USD	1'000.00	13.05.2016	13.05.2019	32 047 466	%	97.100	92.100	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	CHF	1'000.00	06.07.2015	08.07.2019	28 229 462	%	99.540	95.090	95.090		0.000	Y
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.07.2016	15.07.2019	31 883 942	%	103.100	100.000	100.000	13.01. 13.07.	0.000 0.000	N
Protection Participation on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	10.02.2016	12.08.2019	31 336 464	%	104.730	94.920	94.920		0.000	Y
Memory Express on Total	EUR	1'000.00	19.08.2014	19.08.2019	24 350 419	CHF	1217.770	97.180	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	22.08.2017	22.08.2019	37 823 408	%	97.990	90.000	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.09.2016	09.09.2019	33 471 674	%	103.050	96.800	100.000		0.000	Y
ProNote on CS ARROW Excess Return Index	USD	1'000.00	14.10.2014	10.10.2019	23 717 926	%	110.930	90.880	100.000		0.000	Y
ProNote on Credit Suisse Index	USD	1'000.00	14.10.2014	15.10.2019	23 717 925	%	101.090	90.880	100.000		0.000	Y
Protection Participation on S&P 500	USD	1'000.00	20.10.2017	21.10.2019	38 486 743	%	101.120	91.650	95.000		0.000	Y
Protection Participation on S&P 500	USD	1'000.00	22.10.2014	22.10.2019	25 234 367	%	121.150	92.690	100.000		0.000	Y
Memory Express Airbag on reg.shs E.ON	EUR	1'000.00	25.11.2014	25.11.2019	25 013 037	CHF	1124.740	98.015	100.000		0.000	Y
ProNote on CS RAII HOLT Relative Value Idx	USD	1'000.00	10.06.2014	10.12.2019	22 882 349	%	97.610	91.040	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	CHF	1'000.00	15.06.2015	16.12.2019	28 229 084	%	99.380	95.090	95.090		0.000	Y
3.75 % Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	15.12.2015	16.12.2019	27 822 623	%	103.260	100.000	100.000	15.06. 15.12.	0.65217 0.65349	N
ProNote on CS Raii HOLT Relative Value Idx	USD	1'000.00	17.06.2014	17.12.2019	24 261 833	%	96.750	90.000	100.000		0.000	Y
ProNote on Credit Suisse RAII Holt Ix	USD	1'000.00	14.07.2014	14.01.2020	23 717 921	%	97.250	90.170	100.000		0.000	Y
4.25 % Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	15.01.2016	15.01.2020	30 615 566	%	104.260	100.000	100.000	16.01. 17.07.	0.64329 0.66279	N
Express Zertifikat on Euro Stoxx 50 Index	EUR	100.00	23.02.2015	23.01.2020	25 688 969	CHF	131.610	98.613	100.000		0.000	Y
Switchable Capital Protected Note on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	27.02.2015	27.02.2020	26 364 521	%	99.180	91.740	100.000		0.000	Y
Protection Participation on S&P 500	USD	1'000.00	02.03.2015	02.03.2020	26 481 055	%	110.280	91.920	100.000		0.000	Y
Protection Participation on iShs MSCI Ger	USD	1'000.00	02.03.2015	02.03.2020	26 481 056	%	103.910	91.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	08.03.2017	09.03.2020	31 884 050	%	75.360	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on iShs MSCI Ger	USD	1'000.00	10.03.2015	10.03.2020	27 223 816	%	104.930	91.650	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Sel Sct Financial	USD	1'000.00	10.03.2015	10.03.2020	27 223 819	%	105.670	91.650	100.000		0.000	Y
Protection Participation on S&P 500	USD	1'000.00	10.03.2015	10.03.2020	27 223 817	%	110.630	91.650	100.000		0.000	Y
Protection Participation on STXG S100USDP	USD	1'000.00	15.03.2017	16.03.2020	35 784 117	%	102.390	94.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.03.2016	18.03.2020	30 800 033	%	105.400	94.960	100.000		0.000	Y
Protection Participation on STXG S100USDP	USD	1'000.00	23.03.2017	23.03.2020	35 784 321	%	100.600	94.570	100.000		0.000	Y
Protection Participation on iShs MSCI Ger	USD	1'000.00	25.03.2015	25.03.2020	27 224 075	%	102.350	92.420	100.000		0.000	Y
Protection Participation on iShs MSCI Ger	USD	1'000.00	25.03.2015	25.03.2020	27 224 076	%	102.340	92.420	100.000		0.000	Y
Protection Participation on iShs MSCI Ger	USD	1'000.00	30.03.2015	30.03.2020	27 510 948	%	101.420	92.550	100.000		0.000	Y
Protection Participation on iShs MSCI Ger	USD	1'000.00	30.03.2015	30.03.2020	27 510 943	%	101.590	92.550	100.000		0.000	Y
Protection Participation on iShs MSCI Ger	USD	1'000.00	15.04.2015	15.04.2020	27 511 185	%	101.440	92.730	100.000		0.000	Y
ProNote on CS Systematic Tactical Index	EUR	1'000.00	15.05.2015	15.05.2020	25 775 436	%	95.550	86.570	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.968%	USD	1'000.00	30.05.2017	29.05.2020	36 211 899		-	95.120	100.000		0.000	Y
Memory Express on reg.shs BASF 7.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.555%	EUR	1'000.00	07.01.2015	07.07.2020	25 013 034		-	97.922	100.000		0.000	Y
Protection Participation on S&P 500	USD	1'000.00	09.07.2015	09.07.2020	28 229 523	%	112.350	91.730	100.000		0.000	Y
Protection Participation on S&P 500	USD	1'000.00	18.08.2017	18.08.2020	37 823 390	%	102.870	90.290	95.000		0.000	Y
Protection Participation on S&P 500	USD	1'000.00	28.08.2015	28.08.2020	28 887 487	%	124.710	91.050	98.000		0.000	Y
Protection Participation on STXG S100USDP	USD	1'000.00	17.03.2017	17.09.2020	35 784 204	%	101.800	93.300	100.000		0.000	Y
Credit Linked Note VRN Credit Linked on Lafarge SA Refenence Ent	EUR	10'000.00	13.09.2013	20.09.2020	22 153 875	%	106.080	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	69.288 71.343 75.808 76.040	N
Protection Participation on iShs MSCI Em Mk	USD	1'000.00	16.11.2015	16.11.2020	30 234 075	%	118.720	92.090	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Protection Participation on iShs MSCI Em Mk	USD	1'000.00	16.11.2015	16.11.2020	30 234 083	%	118.120	92.090	100.000		0.000	Y
Protection Participation on iShs MSCI Em Mk	USD	1'000.00	17.11.2015	17.11.2020	30 234 093	%	118.370	92.090	100.000		0.000	Y
(1 % min.) Floored Floater Floating Rate	USD	1'000.00	31.01.2014	31.01.2021	21 272 395	%	98.590	100.000	100.000	31.01. 02.05. 31.07. 31.10.	2.521 2.610 2.821 3.339	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.03.2016	18.03.2021	30 800 034	%	107.100	93.240	100.000		0.000	Y
Credit Linked Notes VRN Credit Linked on Stena Ab Ref Ent S122	EUR	1'000.00	18.02.2014	20.03.2021	22 882 191	%	100.190	100.000	100.000	20.03.	12.996	N
Protection Participation on Pfizer	USD	1'000.00	22.03.2016	22.03.2021	31 337 172	%	113.600	93.060	100.000		0.000	Y
Protection Participation on United Parcel Svc-B	USD	1'000.00	22.03.2016	22.03.2021	31 337 173	%	114.760	93.060	100.000		0.000	Y
Protection Participation on S&P 500	USD	1'000.00	21.03.2017	22.03.2021	35 784 366	%	107.190	87.420	95.000		0.000	Y
Protection Participation on Indicies	USD	1'000.00	13.04.2016	13.04.2021	30 800 035	%	110.380	94.350	100.000		0.000	Y
Memory Express Airbag VRN on Deutsche Telekom AG Shs 11.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.282%	EUR	1'000.00	09.07.2015	09.07.2021	28 246 140		-	96.284	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	14.07.2015	14.07.2021	28 229 543	CHF	1157.670	89.640	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	CHF	1'000.00	19.07.2017	19.07.2021	37 174 860	%	100.620	90.000	90.000		0.000	Y
Protection Participation on STXE S50EURP	USD	1'000.00	06.09.2016	07.09.2021	33 471 610	%	96.300	94.400	100.000		0.000	Y
8.05 % Callable Credit Linked Note Cr Lnk on Scandinavian Airlines System SAS Ent	USD	1'000.00	02.07.2014	20.09.2021	24 261 805	%	88.970	100.000	100.000	20.09.	77.426	N
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	28.09.2017	28.09.2021	37 175 988	%	98.200	92.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	29.09.2017	29.09.2021	37 176 020	%	98.500	96.060	100.000		0.000	Y
Protection Participation on NASDAQ 100	USD	1'000.00	20.10.2017	20.10.2021	38 486 744	%	97.930	87.800	95.000		0.000	Y
Protection Participation on Pfizer	USD	1'000.00	16.11.2016	16.11.2021	34 150 979	%	104.930	92.600	100.000		0.000	Y
Credit Linked Note VRN Cr Lnk on Petroleo Brasileiro Ref Ent S654	CHF	1'000.00	23.10.2014	20.12.2021	24 988 441	%	96.920	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	7.500 7.500 7.500 7.500	N
Protection Participation on STOXX GI SD 100	USD	1'000.00	08.03.2017	08.03.2022	35 783 908	%	94.620	90.170	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Singapore Free	USD	1'000.00	19.06.2017	20.06.2022	33 214 249	CHF	1065.390	91.240	100.000		0.000	Y
Protection Participation on iShs MSCI Ger	USD	1'000.00	21.06.2017	21.06.2022	36 212 434	%	96.650	91.240	100.000		0.000	Y
Protection Participation on iShs MSCI Em Mk	USD	1'000.00	21.06.2017	21.06.2022	36 212 436	%	102.160	91.240	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Singapore Free	USD	1'000.00	05.07.2017	05.07.2022	37 174 528	CHF	1096.470	91.380	100.000		0.000	Y
Protection Participation on S&P 500	USD	1'000.00	12.09.2017	12.09.2022	37 823 587	%	101.210	91.780	100.000		0.000	Y
Protection Participation on CS Managed Multi-Asset TR	USD	150'000.00	18.10.2016	18.10.2022	33 214 223	%	103.930	92.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.11.2017	29.11.2022	39 084 739	%	92.800	90.040	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Pfizer	USD	1'000.00	14.09.2016	14.09.2023	33 471 885	%	98.500	91.290	100.000		0.000	Y
Step-Up Contingent Coupon Callable Yield Notes Sr Lkd to Basket of Indices Var Rt	USD	1'000.00	31.10.2014	31.10.2024	25 932 358	%	100.620	78.241	100.000		0.000	Y
ProNote on CS Dynamic Risk Allocation Ix	CHF	1'000.00	08.05.2015	08.05.2025	25 775 421	%	98.110	90.000	100.000		0.000	Y
Pro Note on Credit Suisse Systematic Ix	CHF	1'000.00	29.06.2015	27.06.2025	25 775 430	%	102.180	98.860	103.500		0.000	Y
ProNote on CS Dynamic Risk Allocation Index	CHF	1'000.00	10.08.2015	08.08.2025	25 775 434	%	92.450	89.900	93.000		0.000	Y
ProNote on Credit Suisse Systematic Index	CHF	100.00	18.12.2015	18.12.2025	25 775 440	%	102.030	91.550	92.500		0.000	Y
ProNote on Cs Systematic Tactical Ass Ix	CHF	100.00	18.12.2015	18.12.2025	25 775 439	%	100.280	96.500	97.500		0.000	Y
ProNote with Participation on Systematic Tactical Asset Ret Ix	CHF	100.00	22.04.2016	22.04.2026	25 775 443	%	105.480	92.500	92.500		0.000	Y
ProNote with Participation on Systematic Tactical Asset Ret Ix	CHF	100.00	22.04.2016	22.04.2026	25 775 444	%	103.950	95.000	95.000		0.000	Y
Floored Notes on BFI C-QUADRAT ARTS Balanced Fd	CHF	1'000.00	07.07.2016	07.07.2026	25 775 447	%	96.390	88.000	88.000		0.000	Y
Protection Participation on CS STAA 6% CHF ER	CHF	100.00	22.07.2016	22.07.2026	25 775 448	%	99.410	95.000	95.000		0.000	Y
Structured Note on STAACE6	CHF	100.00	22.07.2016	22.07.2026	25 775 446	%	100.250	90.000	90.000		0.000	Y
ProNote on ActiveSelect Index	CHF	100.00	01.09.2016	08.09.2026	25 775 445	%	99.650	91.710	91.710		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	08.12.2016	08.12.2026	30 800 040	CHF	1059.800	98.120	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Credit Suisse Systematic Tac	CHF	100.00	13.04.2017	13.04.2027	33 300 865	%	99.720	91.880	92.500		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	08.06.2017	08.06.2027	33 214 234	CHF	969.800	98.710	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Credit Suisse Systematic	CHF	1'000.00	14.07.2017	14.07.2027	33 300 875	%	101.770	87.260	90.000		0.000	Y
Protection Participation on Credit Suisse Systematic	CHF	100.00	14.07.2017	14.07.2027	33 300 876	%	99.430	92.100	95.000		0.000	Y
Protection Participation on CS Systematic Tactical Asset	CHF	100.00	29.09.2017	29.09.2027	35 327 468	%	96.070	87.520	90.000		0.000	Y
Protection Participation on	CHF	100.00	29.09.2017	29.09.2027	35 327 469	%	95.970	89.950	92.500		0.000	Y
Protection Participation on Credit Suisse Systematic	CHF	100.00	22.12.2017	22.12.2027	35 327 470	%	96.460	88.040	90.000		0.000	Y
Protection Participation on CS Systematic Tatctical Asset	CHF	10'000.00	22.12.2017	22.12.2027	35 327 471	%	96.410	90.490	92.500		0.000	Y
Credit Suisse AG Nassau Branch, Nassau, Bahamas												
Drop-Back-Cert. on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	03.01.2014	03.01.2017	22 593 737		-	97.610	100.000		0.000	Y
6 3/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	01.07.2015	03.01.2017	25 233 099		-	100.000	100.000	03.01.	0.000	N
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	01.07.2015	03.01.2017	25 233 104		-	98.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on AUD/CHF	AUD	1.00	07.07.2016	09.01.2017	31 647 057		-	100.000	100.000	09.01.	0.00746	Y
6.1 % Callable Barrier Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	16.07.2014	16.01.2017	23 071 722		-	100.000	100.000	16.01.	1.822	N
5 3/4 % Callable Barrier Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	16.07.2014	16.01.2017	23 071 721		-	100.000	100.000	16.01.	0.350	N
7 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.07.2015	16.01.2017	24 874 879		-	100.000	100.000	16.01.	0.48246	N
6 1/4 % Barrier Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	16.07.2014	17.01.2017	23 071 723		-	100.000	100.000	17.01.	4.211	N
8 1/2 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.07.2015	17.01.2017	24 874 878		-	100.000	100.000	17.01.	3.258	N
5 1/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.07.2015	17.01.2017	24 874 882		-	100.000	100.000	17.01.	0.000	N
Drop-Back-Cert. on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	23.01.2014	23.01.2017	22 593 744		-	97.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Roche Hldg G	USD	1'000.00	22.01.2015	23.01.2017	24 439 922		-	98.320	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	22.01.2015	23.01.2017	25 232 246		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	23.01.2015	23.01.2017	25 232 247		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CS Group N	USD	1'000.00	24.07.2015	24.01.2017	28 845 382		-	98.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	27.01.2015	27.01.2017	25 232 262		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	27.01.2015	27.01.2017	25 232 263		-	98.570	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	27.07.2015	27.01.2017	28 845 372		-	98.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	28.01.2015	30.01.2017	25 232 266		-	98.570	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	28.01.2015	30.01.2017	25 232 265		-	98.570	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	29.01.2015	30.01.2017	25 232 275		-	98.490	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	30.01.2015	30.01.2017	25 232 285		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	30.01.2015	30.01.2017	25 232 284		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	30.01.2015	30.01.2017	25 232 282		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.01.2015	30.01.2017	25 232 289		-	98.490	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.07.2015	30.01.2017	28 883 842		-	100.000	100.000	30.01.	0.000	N
7 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.07.2015	30.01.2017	24 874 900		-	100.000	100.000	30.01.	0.000	N
8 1/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.01.2016	30.01.2017	30 012 897		-	100.000	100.000	30.01.	0.000	N
Drop-Back-Cert. on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	31.01.2014	31.01.2017	22 593 742		-	97.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.02.2015	06.02.2017	25 232 314		-	98.490	100.000		0.000	Y
6 1/2 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	07.08.2015	07.02.2017	28 883 877		-	100.000	100.000	07.02.	0.000	N
6.7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.08.2015	07.02.2017	28 883 878		-	100.000	100.000	07.02.	0.000	N
Reverse Convertible 2017-07.02.17 (Exp.03.02.17) on EUR/USD	EUR	1.00	26.01.2017	07.02.2017	34 646 602		-	100.000	100.000	07.02.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-09.02.17 (Exp.07.02.17) on EUR/USD	USD	1.00	26.01.2017	09.02.2017	34 646 606		-	100.000	100.000	09.02.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-09.02.17 (Exp.07.02.17) on EUR/USD	EUR	1.00	26.01.2017	09.02.2017	34 646 603		-	100.000	100.000	09.02.	0.000	Y
Bonus Certificates on Indices	EUR	1'000.00	12.02.2014	13.02.2017	20 970 242		-	98.270	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	11.02.2015	13.02.2017	25 232 338		-	98.530	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	11.02.2015	13.02.2017	25 232 337		-	98.530	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.08.2015	13.02.2017	24 874 918		-	100.000	100.000	11.02.	3.668	N
12.7 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	15.02.2016	15.02.2017	30 012 934		-	100.000	100.000	15.02.	0.000	N
Reverse Convertible 2017-15.02.17 (Exp.13.02.17) on EUR/USD	USD	1.00	26.01.2017	15.02.2017	34 646 600		-	100.000	100.000	15.02.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-15.02.17 (Exp.13.02.17) on EUR/USD	EUR	1.00	26.01.2017	15.02.2017	34 646 601		-	100.000	100.000	15.02.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-15.02.17 (Exp.13.02.17) on EUR/USD	USD	1.00	01.02.2017	15.02.2017	34 646 641		-	100.000	100.000	15.02.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-15.02.17 (Exp.13.02.17) on USD/CHF	USD	1.00	01.02.2017	15.02.2017	34 646 640		-	100.000	100.000	15.02.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-16.02.17 (Exp.14.02.17) on USD/CHF	USD	1.00	02.02.2017	16.02.2017	34 646 658		-	100.000	100.000	16.02.	0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	17.02.2015	17.02.2017	25 232 375		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	18.02.2015	20.02.2017	25 232 384		-	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.08.2015	20.02.2017	24 874 929		-	100.000	100.000	20.02.	0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.02.2015	21.02.2017	25 232 386		-	98.190	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	23.02.2015	23.02.2017	25 232 409		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.02.2015	24.02.2017	25 232 415		-	98.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.02.2015	24.02.2017	25 232 416		-	98.230	100.000		0.000	Y
Drop-Back Cert. on Euro Stoxx 50-Index	CHF	1'000.00	27.02.2014	27.02.2017	22 593 753		-	99.520	100.000		0.000	Y
Drop-Back-Cert. on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	27.02.2014	27.02.2017	22 593 752		-	97.550	100.000		0.000	Y
Drop-Back-Cert. on Euro Stoxx 50-Index	EUR	1'000.00	27.02.2014	27.02.2017	22 593 755		-	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.02.2015	27.02.2017	25 232 435		-	98.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.02.2015	27.02.2017	25 232 434		-	98.140	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	27.02.2015	27.02.2017	25 232 438		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	25.08.2015	27.02.2017	28 883 965		-	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.08.2015	27.02.2017	24 874 937		-	100.000	100.000	27.02.	0.16008	N
Reverse Convertible 2017-27.02.17 (Exp.23.02.17) on EUR/USD	EUR	1.00	26.01.2017	27.02.2017	34 646 610		-	100.000	100.000	27.02.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-27.02.17 (Exp.23.02.17) on EUR/USD	USD	1.00	26.01.2017	27.02.2017	34 646 608		-	100.000	100.000	27.02.	0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.08.2015	28.02.2017	28 883 992		-	98.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.11.2015	28.02.2017	28 884 300		-	99.100	100.000		0.000	Y
(1.05 % min. - 2.1 % max.) Capital Protected Note	CHF	1'000.00	01.03.2012	01.03.2017	14 132 272		-	100.000	100.000	01.03.	2.625	N
(2.15 % p.a. min. - 5 % p.a. max.) Capital Protected Notes	USD	1'000.00	01.03.2012	01.03.2017	14 132 274		-	100.000	100.000	01.03.	5.422	N
Reverse Convertible 2017-01.03.17 (Exp.27.02.17) on EUR/USD	EUR	1.00	01.02.2017	01.03.2017	34 646 639		-	100.000	100.000	01.03.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.09.2015	02.03.2017	28 884 016		-	99.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-02.03.17 (Exp.28.02.17) on EUR/USD	EUR	1.00	02.02.2017	02.03.2017	34 646 659		-	100.000	100.000	02.03.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-02.03.17 (Exp.28.02.17) on EUR/USD	USD	1.00	02.02.2017	02.03.2017	34 646 660		-	100.000	100.000	02.03.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-02.03.17 (Exp.28.02.17) on EUR/GBP	EUR	1.00	02.02.2017	02.03.2017	34 646 657		-	100.000	100.000	02.03.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-02.03.17 (Exp.28.02.17) on EUR/USD	EUR	1.00	02.02.2017	02.03.2017	34 646 656		-	100.000	100.000	02.03.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-02.03.17 (Exp.28.02.17) on EUR/USD	EUR	1.00	02.02.2017	02.03.2017	34 646 654		-	100.000	100.000	02.03.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-02.03.17 (Exp.28.02.17) on USD/CHF	CHF	1.00	02.02.2017	02.03.2017	34 646 652		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-02.03.17 (Exp.28.02.17) on AUD/CHF	AUD	1.00	02.02.2017	02.03.2017	34 646 651		-	100.000	100.000	02.03.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-02.03.17 (Exp.28.02.17) on USD/CHF	CHF	1.00	02.02.2017	02.03.2017	34 646 650		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-02.03.17 (Exp.28.02.17) on EUR/NZD	NZD	1.00	02.02.2017	02.03.2017	34 646 649		-	100.000	100.000	02.03.	0.000	Y
9 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.09.2015	03.03.2017	24 874 949		-	100.000	100.000	03.03.	3.436	N
8.9 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.09.2015	03.03.2017	24 874 960		-	100.000	100.000	03.03.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.03.2015	06.03.2017	25 232 481		-	98.260	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Eni	EUR	1'000.00	06.03.2015	06.03.2017	25 232 475		-	99.810	100.000		0.000	Y
7 1/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.09.2015	08.03.2017	24 874 955		-	100.000	100.000	08.03.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	10.03.2015	10.03.2017	25 232 491		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.03.2015	13.03.2017	25 232 499		-	99.800	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	15.12.2014	15.03.2017	24 439 856		-	97.870	100.000		0.000	Y
3 1/2 % Barrier Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	17.09.2013	17.03.2017	21 930 217		-	100.000	100.000	17.03.	2.373	N
4 % Barrier Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	17.09.2013	17.03.2017	21 930 218		-	100.000	100.000	17.03.	5.353	N
6.8 % ReverseConvertible on Indices	USD	1'000.00	17.09.2014	17.03.2017	23 071 807		-	100.000	100.000	17.03.	5.089	N
6 1/4 % Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	17.09.2014	17.03.2017	23 071 808		-	100.000	100.000	17.03.	1.232	N
6 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	17.09.2014	17.03.2017	23 071 809		-	100.000	100.000	17.03.	0.150	N
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	17.03.2015	17.03.2017	25 232 539		-	98.130	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	17.09.2015	17.03.2017	28 884 093		-	98.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.03.2015	20.03.2017	25 232 550		-	98.110	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	19.03.2015	20.03.2017	24 874 722		-	98.180	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	19.03.2015	20.03.2017	25 232 552		-	99.999	100.000		0.000	Y
3 1/4 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	19.03.2015	20.03.2017	24 874 721		-	100.000	100.000	20.03.	0.000	N
Underlying Tracker on CS Group N	CHF	1'000.00	20.03.2015	20.03.2017	24 874 728		-	99.999	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur GrpN	CHF	1'000.00	20.03.2015	20.03.2017	24 874 727		-	99.999	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	20.03.2015	20.03.2017	25 232 568		-	98.170	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	20.03.2015	20.03.2017	25 232 567		-	98.170	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	20.03.2015	20.03.2017	25 232 526		-	98.060	100.000		0.000	Y
7.5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.09.2015	20.03.2017	24 874 973		-	100.000	100.000	18.03.	0.30009	N
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	22.09.2015	22.03.2017	28 884 104		-	99.980	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	23.09.2015	23.03.2017	28 884 108		-	98.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	24.03.2015	24.03.2017	25 232 576		-	98.180	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	24.03.2015	24.03.2017	25 232 579		-	98.150	100.000		0.000	Y
Drop Back-Cert. on Euro Stoxx 50-Index	EUR	1'000.00	27.03.2014	27.03.2017	23 651 559		-	98.050	100.000		0.000	Y
Drop-Back-Cert. on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	27.03.2014	27.03.2017	23 651 556		-	97.060	100.000		0.000	Y
4 3/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	25.03.2015	27.03.2017	24 874 735		-	100.000	100.000	27.03.	0.000	N
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	25.03.2015	27.03.2017	25 232 582		-	98.220	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	26.03.2015	27.03.2017	25 232 584		-	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.03.2015	27.03.2017	24 874 740		-	100.000	100.000	27.03.	0.000	N
5 1/8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.09.2015	29.03.2017	24 874 989		-	100.000	100.000	29.03.	0.000	N
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	29.09.2015	29.03.2017	28 884 124		-	99.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on GBP/CHF	GBP	1.00	29.12.2016	29.03.2017	34 646 370		-	100.000	100.000	29.03.	0.000	Y
5 % Barrier Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	30.09.2013	30.03.2017	21 930 255		-	100.000	100.000	30.03.	4.930	N
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	31.03.2015	31.03.2017	25 232 599		-	99.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.03.2015	31.03.2017	25 232 601		-	98.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on GDF Suez	EUR	1'000.00	31.03.2015	31.03.2017	25 232 608		-	99.800	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	31.03.2015	31.03.2017	25 232 607		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	01.04.2015	03.04.2017	27 433 597		-	99.999	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	03.04.2015	03.04.2017	25 232 618		-	98.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-03.04.17 (Exp.30.03.17) on USD/CHF	CHF	1.00	02.02.2017	03.04.2017	34 646 655		-	100.000	100.000		0.000	Y
(no min.) Credit Linked Note with credit risk	CHF	5'000.00	14.03.2014	04.04.2017	22 593 761		-	100.000	100.000	04.01. 04.04.	12.777 12.760	N
Reverse Convertible on Gold 1 Uz	USD	1.00	03.10.2016	05.04.2017	33 018 306		-	100.000	100.000	05.04.	0.010	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.04.2015	06.04.2017	25 232 628		-	98.360	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.04.2015	06.04.2017	25 232 627		-	98.360	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.04.2015	06.04.2017	25 232 626		-	98.360	100.000		0.000	Y
14 1/2 % Reverse Convertible Called for red.on 06.01.17 at 100% 6.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	06.04.2016	06.04.2017	30 013 003		-	100.000	100.000	06.01.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	08.04.2015	10.04.2017	25 232 635		-	98.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on EUR/USD	EUR	1.00	13.04.2016	10.04.2017	31 646 435		-	100.000	100.000	10.04.	0.000	Y
Reverse Convertible on Celgene Corp	USD	89.45	15.04.2016	12.04.2017	31 883 734		-	100.000	100.000		0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.04.2015	17.04.2017	25 232 673		-	98.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.04.2015	17.04.2017	25 232 674		-	98.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.04.2015	17.04.2017	25 232 672		-	98.450	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on AbbVie	USD	1'000.00	16.10.2015	17.04.2017	28 884 171		-	99.070	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on Equities	CHF	1'000.00	16.04.2014	18.04.2017	23 071 636		-	99.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	17.04.2015	18.04.2017	25 232 695		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 19.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	19.01.2016	19.04.2017	30 485 132		-	98.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Amgen	USD	138.60	21.04.2016	19.04.2017	31 883 750		-	100.000	100.000		0.000	N
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.10.2015	20.04.2017	28 845 455		-	100.000	100.000	20.04.	0.000	N
Underlying Tracker on Volkswagen Vz	EUR	1'000.00	21.04.2015	21.04.2017	25 232 712		-	99.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	21.04.2015	21.04.2017	25 232 719		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Schlumberger	USD	1'000.00	21.04.2015	21.04.2017	25 232 718		-	98.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on General Electric	USD	1'000.00	21.04.2015	21.04.2017	25 232 717		-	98.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Medtronic	USD	1'000.00	21.04.2015	21.04.2017	25 232 716		-	98.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	21.04.2015	21.04.2017	25 232 713		-	98.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	21.04.2015	21.04.2017	25 232 711		-	99.860	100.000		0.000	Y
5 1/4 % Reverse Convertible on Indices 23.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	21.10.2015	21.04.2017	24 875 005		-	100.000	100.000	23.01.	0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	21.10.2015	21.04.2017	24 875 015		-	100.000	100.000	21.04.	0.000	N
Bonus Certificate on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	22.04.2014	24.04.2017	23 071 610		-	98.220	100.000		0.000	Y
Drop Back-Cert. on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	22.04.2014	24.04.2017	23 651 585		-	97.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.04.2015	24.04.2017	25 232 733		-	98.470	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	22.04.2015	24.04.2017	25 232 726		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	22.04.2015	24.04.2017	25 232 735		-	99.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	22.04.2015	24.04.2017	25 232 734		-	99.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.04.2015	24.04.2017	25 232 736		-	98.470	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	22.04.2015	24.04.2017	24 874 766		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	23.04.2015	24.04.2017	25 232 739		-	98.470	100.000		0.000	Y
4 1/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.04.2015	24.04.2017	24 874 770		-	100.000	100.000	24.04.	0.000	N
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.04.2015	24.04.2017	25 232 742		-	99.880	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	24.04.2015	24.04.2017	25 232 743		-	98.460	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Drop Back-Cert. on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	25.04.2014	25.04.2017	23 651 575		-	97.150	100.000		0.000	Y
Drop Back-Cert. on Euro Stoxx 50-Index	EUR	1'000.00	25.04.2014	25.04.2017	23 651 574		-	98.340	100.000		0.000	Y
Drop-Back-Cert. on Euro Stoxx 50-Index	CHF	1'000.00	25.04.2014	25.04.2017	23 651 555		-	99.580	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-26.04.17 (Exp.24.04.17) on EUR/USD	EUR	1.00	26.01.2017	26.04.2017	34 646 599		-	100.000	100.000	26.04.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.04.2015	27.04.2017	25 232 748		-	98.480	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	27.10.2015	27.04.2017	28 884 190		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	28.04.2015	28.04.2017	25 232 752		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	29.04.2015	28.04.2017	25 232 757		-	99.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.04.2015	28.04.2017	25 232 762		-	98.390	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	30.04.2015	28.04.2017	25 232 769		-	99.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Linde	EUR	114.25	28.12.2015	28.04.2017	30 012 873		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	29.01.2016	28.04.2017	30 485 231		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-02.05.17 (Exp.27.04.17) on USD/CHF	CHF	1.00	02.02.2017	02.05.2017	34 646 653		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	04.05.2015	04.05.2017	25 232 770		-	100.000	100.000		0.000	Y
14.35 % Reverse Convertible Called for red.on 06.02.17 at 100%	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.05.2017	30 485 484		-	100.000	100.000			N
6.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung										06.02.	0.000	
3 1/2 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	05.05.2015	05.05.2017	24 874 788		-	100.000	100.000	06.02. 05.05.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.05.2015	05.05.2017	25 232 781		-	98.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SGS N	CHF	1'897.80	05.11.2015	05.05.2017	30 112 496		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SGS N	CHF	1'876.80	05.11.2015	05.05.2017	30 112 495		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.05.2015	08.05.2017	25 232 798		-	98.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.05.2015	08.05.2017	25 232 797		-	99.830	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on General Electric	USD	1'000.00	09.11.2015	09.05.2017	28 884 221		-	98.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	10.11.2015	10.05.2017	30 112 501		-	98.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	11.11.2014	11.05.2017	24 874 568		-	99.930	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.05.2015	11.05.2017	25 232 802		-	98.290	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.05.2015	11.05.2017	25 232 803		-	98.290	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	11.11.2015	11.05.2017	28 884 236		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.05.2015	15.05.2017	25 232 819		-	98.260	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	14.05.2015	15.05.2017	25 232 830		-	98.240	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	14.05.2015	15.05.2017	25 232 832		-	99.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.716%	USD	1'000.00	14.05.2015	15.05.2017	25 232 833		-	98.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.05.2015	15.05.2017	25 232 831		-	98.240	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Chevron	USD	1'000.00	15.05.2015	15.05.2017	25 232 841		-	98.210	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	15.05.2015	15.05.2017	25 232 842		-	98.320	100.000		0.000	Y
7 3/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	13.11.2015	15.05.2017	24 875 043		-	100.000	100.000	15.05.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	13.11.2015	15.05.2017	28 884 244		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Newmont Mining	USD	20.45	16.03.2016	16.05.2017	30 012 985		-	99.040	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	18.05.2015	18.05.2017	25 232 851		-	98.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	18.05.2015	18.05.2017	25 232 840		-	98.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.05.2015	18.05.2017	25 232 847		-	98.320	100.000		0.000	Y
6 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.11.2015	18.05.2017	24 875 049		-	100.000	100.000	18.05.	0.000	N
6 1/4 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	19.11.2014	19.05.2017	23 071 894		-	100.000	100.000	19.05.	0.100	N
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.05.2015	19.05.2017	25 232 859		-	98.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-19.05.17 (Exp.17.05.17) on USD/MXN	MXN	1.00	12.05.2017	19.05.2017	36 095 556		-	100.000	100.000	19.05.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-19.05.17 (Exp.17.05.17) on EUR/MXN	MXN	1.00	12.05.2017	19.05.2017	36 095 561		-	100.000	100.000	19.05.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-19.05.17 (Exp.17.05.17) on USD/MXN	MXN	1.00	12.05.2017	19.05.2017	36 095 554		-	100.000	100.000	19.05.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-19.05.17 (Exp.17.05.17) on EUR/CHF	CHF	1.00	12.05.2017	19.05.2017	36 095 539		-	100.000	100.000	19.05.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-19.05.17 (Exp.17.05.17) on EUR/MXN	MXN	1.00	12.05.2017	19.05.2017	36 095 553		-	100.000	100.000	19.05.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-19.05.17 (Exp.17.05.17) on EUR/MXN	MXN	1.00	12.05.2017	19.05.2017	36 095 551		-	100.000	100.000	19.05.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-19.05.17 (Exp.17.05.17) on USD/MXN	MXN	1.00	12.05.2017	19.05.2017	36 095 550		-	100.000	100.000	19.05.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-19.05.17 (Exp.17.05.17) on USD/MXN	MXN	1.00	12.05.2017	19.05.2017	36 095 552		-	100.000	100.000	19.05.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-19.05.17 (Exp.17.05.17) on EUR/MXN	MXN	1.00	12.05.2017	19.05.2017	36 095 555		-	100.000	100.000	19.05.	0.000	Y
Drop-Back-Cert. on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	20.05.2014	22.05.2017	24 334 944		-	97.200	100.000		0.000	Y
7.85 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	20.05.2015	22.05.2017	25 232 860		-	100.000	100.000	20.02. 22.05.	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	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Drop Back-Cert. on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	23.05.2014	23.05.2017	23 651 594		-	97.170	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on SMI	CHF	1'000.00	23.05.2014	23.05.2017	23 996 184		-	99.730	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	23.05.2014	23.05.2017	23 996 185		-	98.570	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	23.11.2015	23.05.2017	28 884 264		-	100.000	100.000		0.000	Y
(0.7 % Min.- 2 1/2 % Max.) Floored Floter mit Cap floating rate	CHF	1'000.00	24.05.2012	24.05.2017	14 132 283		-	100.000	100.000	24.02. 24.05.	1.750 1.750	N
(1 1/4 % Min.- 3 3/4 % Max.) Floored Floater mitCap floating rate	EUR	1'000.00	24.05.2012	24.05.2017	14 132 284		-	100.000	100.000	24.02. 24.05.	3.324 3.413	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	26.05.2015	26.05.2017	24 874 813		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Bank of America	USD	1'000.00	26.05.2015	26.05.2017	28 012 787		-	98.340	100.000		0.000	Y
8.7 % Reverse Convertible on Equities 27.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	25.05.2016	26.05.2017	31 883 807		-	100.000	100.000	27.02.	0.000	N
Reverse Convertible on EUR/USD	USD	1.00	07.06.2016	26.05.2017	31 646 799		-	100.000	100.000	26.05.	0.010	Y
Reverse Convertible 2017-26.05.17 (Exp.24.05.17) on EUR/USD	USD	1.00	12.05.2017	26.05.2017	36 095 564		-	100.000	100.000	26.05.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-26.05.17 (Exp.24.05.17) on EUR/USD	USD	1.00	12.05.2017	26.05.2017	36 095 563		-	100.000	100.000	26.05.	0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	27.05.2015	29.05.2017	24 874 830		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	28.05.2015	29.05.2017	25 232 901		-	99.790	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	28.05.2015	29.05.2017	25 232 878		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	28.05.2015	29.05.2017	25 232 900		-	99.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	29.05.2015	29.05.2017	25 232 911		-	99.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	29.05.2015	29.05.2017	25 232 910		-	99.800	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.11.2015	29.05.2017	24 875 061		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	N
Bonus Certificate on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	30.05.2014	30.05.2017	23 996 224		-	97.340	100.000		0.000	Y
Bonus Outperformance-Cert. on Basket	CHF	1'000.00	30.05.2014	30.05.2017	24 334 948		-	99.730	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.05.2015	30.05.2017	25 232 882		-	98.280	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	29.05.2015	30.05.2017	25 232 906		-	98.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.11.2015	30.05.2017	28 884 299		-	98.810	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	30.11.2015	30.05.2017	28 884 305		-	100.000	100.000		0.000	Y
8 1/2 % Reverse Convertible on Equities 28.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.05.2016	30.05.2017	31 883 797		-	100.000	100.000	28.02.	0.000	N
Reverse Convertible on EUR/CHF	CHF	1.00	14.11.2016	30.05.2017	33 018 603		-	100.000	100.000	30.05.	0.000	Y
Reverse Convertible on EUR/USD	USD	1.00	29.11.2016	30.05.2017	33 018 727		-	100.000	100.000	30.05.	0.010	Y
Reverse Convertible on EUR/USD	USD	1.00	09.06.2016	31.05.2017	31 646 813		-	100.000	100.000	31.05.	0.010	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	01.06.2015	01.06.2017	25 232 913		-	98.320	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	01.06.2015	01.06.2017	25 232 917		-	98.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.06.2015	01.06.2017	25 232 916		-	98.330	100.000		0.000	Y
Drop-Back-Cert. on Euro Stoxx 50-Index	EUR	1'000.00	02.06.2014	02.06.2017	24 334 951		-	98.570	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	02.06.2015	02.06.2017	25 232 923		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	02.12.2015	02.06.2017	28 884 314		-	98.770	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	02.03.2016	02.06.2017	30 485 342		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.06.2015	05.06.2017	25 232 948		-	99.800	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	03.12.2015	05.06.2017	30 485 025		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Daimler N	EUR	1'000.00	03.12.2015	05.06.2017	30 485 027		-	100.000	100.000		0.000	Y
Bonus Certificates on Equities	CHF	1'000.00	05.06.2014	06.06.2017	23 071 698		-	99.760	100.000		0.000	Y
5 1/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.06.2015	06.06.2017	24 874 829		-	100.000	100.000	06.06.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	04.06.2015	06.06.2017	25 232 942		-	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	04.12.2015	06.06.2017	30 012 832		-	100.000	100.000	06.06.	0.000	N
8 1/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.12.2015	07.06.2017	30 012 846		-	100.000	100.000	07.03. 07.06.	0.000 0.000	N
6 % Reverse Convertible on Equities 8.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	10'000.00	08.12.2015	08.06.2017	30 012 836		-	100.000	100.000	08.03.	0.000	N
Drop Back-Cert. on Euro Stoxx 50-Index	EUR	1'000.00	09.06.2014	09.06.2017	24 334 957		-	98.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on reg.shs Novartis	CHF	1'000.00	09.06.2015	09.06.2017	27 433 603		-	100.000	100.000		0.000	Y
7 1/2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	09.12.2015	09.06.2017	30 012 840		-	100.000	100.000	09.06.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	09.12.2015	09.06.2017	30 012 833		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-09.06.17 (Exp.07.06.17) on EUR/USD	USD	1.00	02.06.2017	09.06.2017	36 095 710		-	100.000	100.000	09.06.	0.000	Y
Drop Back-Cert. on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	10.06.2014	12.06.2017	24 334 953		-	97.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.06.2015	12.06.2017	25 232 965		-	98.210	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.06.2015	12.06.2017	24 874 839		-	100.000	100.000	12.06.	0.000	N
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.06.2015	12.06.2017	25 232 980		-	99.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.06.2015	12.06.2017	25 232 979		-	99.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.06.2015	12.06.2017	25 232 978		-	99.750	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.12.2015	12.06.2017	30 012 834		-	100.000	100.000	12.06.	0.000	N
Reverse Convertible 2017-12.06.17 (Exp.08.06.17) on EUR/USD	USD	1.00	12.05.2017	12.06.2017	36 095 547		-	100.000	100.000	12.06.	0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible 2017-12.06.17 (Exp.08.06.17) on USD/CHF	USD	1.00	12.05.2017	12.06.2017	36 095 546		-	100.000	100.000	12.06.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-12.06.17 (Exp.08.06.17) on EUR/NOK	EUR	1.00	12.05.2017	12.06.2017	36 095 544		-	100.000	100.000	12.06.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-12.06.17 (Exp.08.06.17) on EUR/USD	USD	1.00	12.05.2017	12.06.2017	36 095 548		-	100.000	100.000	12.06.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-12.06.17 (Exp.08.06.17) on EUR/CHF	EUR	1.00	12.05.2017	12.06.2017	36 095 545		-	100.000	100.000	12.06.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-12.06.17 (Exp.08.06.17) on USD/CHF	CHF	1.00	12.05.2017	12.06.2017	36 095 558		-	100.000	100.000	12.06.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-12.06.17 (Exp.08.06.17) on EUR/USD	USD	1.00	12.05.2017	12.06.2017	36 095 542		-	100.000	100.000	12.06.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-12.06.17 (Exp.08.06.17) on EUR/USD	USD	1.00	12.05.2017	12.06.2017	36 095 560		-	100.000	100.000	12.06.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-12.06.17 (Exp.08.06.17) on GBP/CHF	GBP	1.00	12.05.2017	12.06.2017	36 095 562		-	100.000	100.000	12.06.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-12.06.17 (Exp.08.06.17) on USD/CHF	USD	1.00	12.05.2017	12.06.2017	36 095 557		-	100.000	100.000	12.06.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-12.06.17 (Exp.08.06.17) on XAG/EUR Fixing	EUR	1.00	12.05.2017	12.06.2017	36 095 543		-	100.000	100.000	12.06.	0.000	Y
7 1/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.12.2015	14.06.2017	30 012 845		-	100.000	100.000	14.06.	0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities 14.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	14.06.2016	14.06.2017	31 883 826		-	100.000	100.000	14.03.	0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.06.2015	15.06.2017	25 232 985		-	98.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.06.2015	15.06.2017	25 232 999		-	98.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.06.2015	15.06.2017	25 232 998		-	98.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 16.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.684%	USD	1'000.00	16.06.2015	16.06.2017	25 233 004		-	98.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-16.06.17 (Exp.14.06.17) on EUR/CHF	EUR	1.00	02.06.2017	16.06.2017	36 095 714		-	100.000	100.000	16.06.	0.000	Y
3.4 % Barrier Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	19.12.2013	19.06.2017	22 367 639		-	100.000	100.000	19.06.	1.700	N
Bonus Certificate on SMI	CHF	1'000.00	17.06.2014	19.06.2017	24 408 982		-	99.710	100.000		0.000	Y
Bonus Certificates on Equities	CHF	1'000.00	18.06.2014	19.06.2017	23 071 715		-	99.670	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	17.12.2014	19.06.2017	24 439 864		-	99.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.06.2015	19.06.2017	25 233 009		-	98.080	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.677%	USD	1'000.00	17.06.2015	19.06.2017	25 233 011		-	98.080	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.06.2015	19.06.2017	25 233 006		-	98.080	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.06.2015	19.06.2017	24 874 847		-	100.000	100.000	19.06.	0.000	N
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	1'000.00	17.12.2015	19.06.2017	30 112 532		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 20.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.687%	USD	1'000.00	18.12.2015	19.06.2017	30 485 056		-	98.680	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 20.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.687%	USD	1'000.00	18.12.2015	19.06.2017	30 485 059		-	98.680	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-19.06.17 (Exp.15.06.17) on EUR/CAD	CAD	1.00	02.06.2017	19.06.2017	36 095 716		-	100.000	100.000	19.06.	0.000	Y
Bonus Certificate on S&P 500	USD	1'000.00	20.06.2014	20.06.2017	23 996 186		-	96.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	21.03.2016	21.06.2017	30 485 414		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Aryzta N	CHF	36.75	22.03.2016	22.06.2017	30 012 990		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	23.06.2015	23.06.2017	25 233 052		-	98.090	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	23.06.2015	23.06.2017	25 233 050		-	98.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.06.2015	26.06.2017	25 233 061		-	99.670	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Rio Tinto Sp ADR	USD	1'000.00	25.06.2015	26.06.2017	28 012 827		-	98.220	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	CHF	1'000.00	25.06.2015	26.06.2017	24 874 867		-	100.000	100.000	26.06.	0.000	N
4.35 % Reverse Convertible on Equities 27.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	25.06.2015	26.06.2017	25 233 021		-	100.000	100.000	27.03.	0.000	N
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.06.2015	26.06.2017	25 233 080		-	99.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	26.06.2015	26.06.2017	25 233 077		-	100.000	100.000		0.000	Y
7 1/8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.12.2015	26.06.2017	30 012 864		-	100.000	100.000	26.06.	0.000	N
6 % Reverse Convertible Called for red. on 28.03.17 at 100 % 28.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	28.06.2016	28.06.2017	31 883 847		-	100.000	100.000	28.03.	0.000	N
Bonus Certificates on Equities	CHF	1'000.00	30.06.2014	30.06.2017	23 071 733		-	99.730	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	30.06.2015	30.06.2017	25 233 094		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	01.07.2015	03.07.2017	25 233 098		-	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	01.07.2015	03.07.2017	24 874 866		-	100.000	100.000	03.01. 03.07.	0.000 0.000	N
4 1/2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.07.2015	03.07.2017	25 233 115		-	100.000	100.000	03.01. 03.04. 03.07.	0.000 0.000 0.000	N
7 1/2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.07.2015	03.07.2017	25 233 081		-	100.000	100.000	03.01. 03.04. 03.07.	0.41448 0.4145 0.42472	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	01.07.2016	03.07.2017	32 219 361		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-03.07.17 (Exp.29.06.17) on GBP/USD	USD	1.00	02.06.2017	03.07.2017	36 095 712		-	100.000	100.000	03.07.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-03.07.17 (Exp.29.06.17) on EUR/USD	USD	1.00	02.06.2017	03.07.2017	36 095 715		-	100.000	100.000	03.07.	0.000	Y
Reverse Convertible on Swiss Re N	CHF	72.50	04.07.2016	04.07.2017	32 219 389		-	100.000	100.000		0.000	N
Reverse Convertible 2017-05.07.17 (Exp.03.07.17) on USD/NOK	NOK	1.00	12.05.2017	05.07.2017	36 095 538		-	100.000	100.000	05.07.	0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	06.07.2015	06.07.2017	25 233 121		-	99.730	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.07.2016	06.07.2017	32 219 390		-	100.000	100.000		0.000	N
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 7.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.988%	EUR	1'000.00	07.07.2015	07.07.2017	25 233 136		-	99.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	08.07.2015	10.07.2017	25 233 139		-	99.750	100.000		0.000	Y
7 1/2 % Reverse Convertible callable for red on 09.01.17 at 100 % 9.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.04.2016	10.07.2017	30 013 008		-	100.000	100.000	09.01.	0.000	N
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	12.01.2016	12.07.2017	30 485 092		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	13.07.2015	13.07.2017	25 233 169		-	99.750	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	13.07.2015	13.07.2017	25 233 163		-	100.000	100.000		0.000	Y
7 1/2 % Reverse Convertible on Indices 13.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	13.07.2015	13.07.2017	25 233 164		-	100.000	100.000	13.01.	4.544	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	13.01.2016	13.07.2017	30 485 095		-	100.000	100.000		0.000	Y
7 3/4 % Reverse Convertible called for Red. on 16.01.17 at 100% 16.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	14.01.2016	14.07.2017	30 012 875		-	100.000	100.000	16.01.	0.000	N
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	14.01.2016	14.07.2017	30 485 108		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	14.01.2016	14.07.2017	30 485 107		-	100.000	100.000		0.000	Y
6 1/8 % Reverse Convertible on Equities 16.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	15.07.2015	17.07.2017	24 874 880		-	100.000	100.000	16.01.	0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.07.2015	17.07.2017	25 233 182		-	98.360	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	15.07.2015	17.07.2017	28 845 369		-	88.580	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Airbus Group 17.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.988%	EUR	1'000.00	17.07.2015	17.07.2017	25 233 198		-	99.770	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Societe Generale 17.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.988%	EUR	1'000.00	17.07.2015	17.07.2017	25 233 197		-	99.770	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Adecco Group N	EUR	53.32	17.05.2016	17.07.2017	31 883 788		-	100.000	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on S&P 500	USD	1'000.00	18.07.2014	18.07.2017	24 408 986		-	96.910	100.000		0.000	Y
Bonus Certificates on Equities	CHF	1'000.00	18.07.2014	18.07.2017	23 071 755		-	99.700	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-18.07.17 (Exp.14.07.17) on USD/CHF	CHF	1.00	02.06.2017	18.07.2017	36 095 711		-	100.000	100.000	18.07.	0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	19.01.2016	19.07.2017	30 485 149		-	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.01.2016	19.07.2017	30 012 888		-	100.000	100.000	19.01. 19.04.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	20.01.2016	20.07.2017	30 485 151		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	20.01.2016	20.07.2017	30 485 154		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-20.07.17 (Exp.18.07.17) on EUR/GBP	GBP	1.00	12.05.2017	20.07.2017	36 095 559		-	100.000	100.000	20.07.	0.000	Y
7 % Reverse Convertible called for Red. on 23.01.17 at 100% 23.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	21.01.2015	21.07.2017	24 874 637		-	100.000	100.000	23.01.	0.91226	N
7.6 % Reverse Convertible on Indices 23.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	21.01.2015	21.07.2017	24 874 635		-	100.000	100.000	23.01. 23.01.	4.544 4.544	N
6.5 % Reverse Convertible on Indices 23.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	21.01.2015	21.07.2017	24 874 636		-	100.000	100.000	23.01.	0.000	N
10 3/4 % Reverse Convertible on Equities 23.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	21.07.2016	21.07.2017	31 883 888		-	100.000	100.000	23.01.	0.000	N
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	23.07.2015	24.07.2017	25 233 224		-	99.800	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 23.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.47%	USD	1'000.00	22.01.2016	24.07.2017	30 485 117		-	98.610	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities 24.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	22.04.2016	24.07.2017	30 013 024		-	100.000	100.000	23.01. 24.04.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible 2017-26.07.17 (Exp.24.07.17) on USD/CHF	USD	1.00	26.01.2017	26.07.2017	34 646 604		-	100.000	100.000	26.07.	0.010	Y
Reverse Convertible 2017-26.07.17 (Exp.24.07.17) on USD/CHF	USD	1.00	26.01.2017	26.07.2017	34 646 607		-	100.000	100.000	26.07.	0.010	Y
Reverse Convertible 2017-26.07.17 (Exp.24.07.17) on EUR/CHF	EUR	1.00	19.07.2017	26.07.2017	36 095 986		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-26.07.17 (Exp.24.07.17) on EUR/USD	EUR	1.00	19.07.2017	26.07.2017	36 095 984		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-26.07.17 (Exp.24.07.17) on EUR/USD	EUR	1.00	19.07.2017	26.07.2017	36 095 983		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.461%	USD	1'000.00	27.07.2015	27.07.2017	25 233 234		-	98.100	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Gazprom Sp ADR	USD	1'000.00	27.07.2015	27.07.2017	25 233 233		-	98.160	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible Called for Red. on 27.01.17 at 100% 27.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	27.01.2016	27.07.2017	30 012 905		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	N
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	27.01.2016	27.07.2017	30 485 217		-	100.000	100.000		0.000	Y
(no min.) Daily Accrual Notes on basket 28.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	28.07.2014	28.07.2017	24 409 128		-	96.710	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	28.07.2015	28.07.2017	28 883 835		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on HS China Ent Index	USD	1'000.00	28.07.2015	28.07.2017	28 883 832		-	98.090	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.07.2015	28.07.2017	28 883 837		-	98.100	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible Called for red.on 30.01.17 at 100 % 30.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	28.01.2016	28.07.2017	30 012 895		-	100.000	100.000	30.01.	3.988	N
Reverse Convertible 2017-28.07.17 (Exp.26.07.17) on EUR/USD	EUR	1.00	13.07.2017	28.07.2017	36 095 945		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-28.07.17 (Exp.26.07.17) on USD/MXN	USD	1.00	21.07.2017	28.07.2017	36 096 006		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-28.07.17 (Exp.26.07.17) on EUR/MXN	EUR	1.00	21.07.2017	28.07.2017	36 096 005		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-28.07.17 (Exp.26.07.17) on EUR/MXN	EUR	1.00	21.07.2017	28.07.2017	36 096 003		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-28.07.17 (Exp.26.07.17) on USD/MXN	USD	1.00	21.07.2017	28.07.2017	36 096 002		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-28.07.17 (Exp.26.07.17) on USD/MXN	USD	1.00	21.07.2017	28.07.2017	36 096 000		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-28.07.17 (Exp.26.07.17) on EUR/CHF	CHF	1.00	21.07.2017	28.07.2017	36 095 994		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-28.07.17 (Exp.26.07.17) on EUR/MXN	EUR	1.00	21.07.2017	28.07.2017	36 096 001		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-28.07.17 (Exp.26.07.17) on USD/MXN	USD	1.00	21.07.2017	28.07.2017	36 096 004		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
Bonus Certificate on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	29.07.2014	31.07.2017	24 409 130		-	98.840	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on S&P 500	USD	1'000.00	29.07.2014	31.07.2017	24 409 131		-	96.680	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on S&P 500	USD	1'000.00	29.07.2014	31.07.2017	24 409 132		-	96.680	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	29.07.2014	31.07.2017	24 409 133		-	98.840	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	30.07.2014	31.07.2017	24 409 142		-	98.800	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on S&P 500	USD	1'000.00	30.07.2014	31.07.2017	24 409 147		-	96.680	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.07.2015	31.07.2017	24 874 899		-	100.000	100.000	30.01. 31.07.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.07.2015	31.07.2017	28 883 843		-	98.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Zurich Insur GrpN	CHF	1'000.00	30.07.2015	31.07.2017	28 294 092		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	30.07.2015	31.07.2017	28 883 847		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	31.07.2015	31.07.2017	28 883 854		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Airbus Group	EUR	1'000.00	29.01.2016	31.07.2017	30 485 229		-	100.000	100.000		0.000	Y
6.65 % Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	29.01.2016	31.07.2017	30 112 548		-	100.000	100.000	30.01. 31.07.	0.000 0.000	N
Drop-Back-Cert. on Euro Stoxx 50-Index	EUR	1'000.00	01.08.2014	01.08.2017	24 903 150		-	98.810	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	CHF	1'000.00	02.02.2016	02.08.2017	30 012 900		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	02.02.2016	02.08.2017	30 485 250		-	98.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-02.08.17 (Exp.31.07.17) on GBP/USD	GBP	1.00	19.07.2017	02.08.2017	36 095 981		-	100.000	100.000	02.08.	0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible 2017-02.08.17 (Exp.31.07.17) on GBP/USD	USD	1.00	19.07.2017	02.08.2017	36 095 987		-	100.000	100.000	02.08.	0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities 3.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	03.08.2016	03.08.2017	32 219 465		-	100.000	100.000	03.02.	0.000	N
8 % Reverse Convertible on Equities 3.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	03.08.2016	03.08.2017	32 219 464		-	100.000	100.000	03.02.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	04.08.2015	04.08.2017	28 883 864		-	98.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.08.2015	04.08.2017	28 883 865		-	98.200	100.000		0.000	Y
4.85 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	04.08.2015	04.08.2017	28 883 839		-	100.000	100.000	06.02. 04.05. 04.08.	0.000 0.000 0.000	N
5 % Reverse Convertible on Equities 4.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	04.05.2016	04.08.2017	31 883 758		-	100.000	100.000	06.02. 04.05.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	05.08.2015	07.08.2017	28 883 871		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.08.2015	07.08.2017	28 883 872		-	98.190	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.08.2015	07.08.2017	24 874 912		-	100.000	100.000	06.02. 07.08.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	05.02.2016	07.08.2017	30 485 262		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-07.08.17 (Exp.03.08.17) on EUR/USD	EUR	1.00	21.07.2017	07.08.2017	36 096 014		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ING Group	EUR	1'000.00	08.02.2016	08.08.2017	30 485 269		-	100.000	100.000		0.000	Y
2.2 % Reverse Convertible on MSCI World Index	EUR	100'000.00	08.08.2016	08.08.2017	32 646 834		-	100.000	100.000	08.08.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-08.08.17 (Exp.04.08.17) on GBP/CHF	GBP	1.00	21.07.2017	08.08.2017	36 095 999		-	100.000	100.000	08.08.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-08.08.17 (Exp.04.08.17) on EUR/USD	EUR	1.00	21.07.2017	08.08.2017	36 095 998		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Procter&Gamble	USD	1'000.00	10.08.2015	10.08.2017	28 883 881		-	98.210	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.08.2015	10.08.2017	28 883 868		-	99.800	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	10.02.2016	10.08.2017	30 485 277		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.08.2015	11.08.2017	28 883 882		-	98.210	100.000		0.000	Y
Express Certificates with Memory Payout on Funds	USD	1'000.00	12.08.2014	14.08.2017	24 409 182		-	96.660	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	13.08.2015	14.08.2017	28 883 892		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	13.08.2015	14.08.2017	28 883 896		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.08.2015	14.08.2017	28 883 903		-	98.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.08.2015	14.08.2017	28 883 904		-	98.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.08.2015	14.08.2017	28 883 902		-	98.090	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	14.08.2015	14.08.2017	28 883 907		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	14.08.2015	14.08.2017	28 883 906		-	100.000	100.000		0.000	Y
7.5 % Reverse Convertible Called for red.on 13.02.17 at 100 % 13.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	12.02.2016	14.08.2017	30 012 915		-	100.000	100.000	13.02.	0.000	N
8 % Reverse Convertible Called for red.on 13.02.17 at 100 % 13.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	12.08.2016	14.08.2017	31 883 920		-	100.000	100.000	13.02.	2.135	N
Reverse Convertible 2017-14.08.17 (Exp.10.08.17) on USD/CHF	USD	1.00	12.05.2017	14.08.2017	36 095 540		-	100.000	100.000	14.08.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-14.08.17 (Exp.10.08.17) on USD/CHF	USD	1.00	12.05.2017	14.08.2017	36 095 541		-	100.000	100.000	14.08.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-14.08.17 (Exp.10.08.17) on USD/CHF	USD	1.00	12.05.2017	14.08.2017	36 095 549		-	100.000	100.000	14.08.	0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	16.02.2016	16.08.2017	30 485 296		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.08.2015	17.08.2017	28 883 918		-	98.150	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	17.08.2015	17.08.2017	28 883 913		-	100.000	100.000		0.000	Y
7 1/2 % Reverse Convertible Called for Red. on 17.02.17 at 100% 17.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	17.05.2016	17.08.2017	31 883 777		-	100.000	100.000	17.02.	0.000	N
6 1/2 % Reverse Convertible on Indices 20.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.02.2015	18.08.2017	24 874 667		-	100.000	100.000		0.000	N
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.08.2015	18.08.2017	24 874 924		-	100.000	100.000	20.02. 18.08.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	19.08.2015	21.08.2017	28 883 936		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.08.2015	21.08.2017	28 883 950		-	99.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.08.2015	21.08.2017	28 883 951		-	99.840	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	20.08.2015	21.08.2017	28 883 955		-	98.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-21.08.17 (Exp.17.08.17) on EUR/CAD	EUR	1.00	19.07.2017	21.08.2017	36 095 988		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-21.08.17 (Exp.17.08.17) on EUR/GBP	GBP	1.00	19.07.2017	21.08.2017	36 095 979		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible 2017-21.08.17 (Exp.17.08.17) on EUR/USD	EUR	1.00	19.07.2017	21.08.2017	36 095 980		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-21.08.17 (Exp.17.08.17) on USD/CHF	USD	1.00	19.07.2017	21.08.2017	36 095 982		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-21.08.17 (Exp.17.08.17) on EUR/USD	EUR	1.00	19.07.2017	21.08.2017	36 095 985		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-21.08.17 (Exp.17.08.17) on EUR/USD	USD	1.00	21.07.2017	21.08.2017	36 096 012		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-21.08.17 (Exp.17.08.17) on USD/CHF	USD	1.00	21.07.2017	21.08.2017	36 096 015		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-21.08.17 (Exp.17.08.17) on EUR/USD	USD	1.00	21.07.2017	21.08.2017	36 096 013		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-21.08.17 (Exp.17.08.17) on EUR/CHF	EUR	1.00	21.07.2017	21.08.2017	36 096 011		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-21.08.17 (Exp.17.08.17) on EUR/CHF	EUR	1.00	21.07.2017	21.08.2017	36 096 010		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-21.08.17 (Exp.17.08.17) on EUR/CHF	EUR	1.00	21.07.2017	21.08.2017	36 096 009		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-21.08.17 (Exp.17.08.17) on EUR/CHF	EUR	1.00	21.07.2017	21.08.2017	36 096 008		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-21.08.17 (Exp.17.08.17) on EUR/CHF	EUR	1.00	21.07.2017	21.08.2017	36 096 007		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-21.08.17 (Exp.17.08.17) on EUR/NOK	NOK	1.00	21.07.2017	21.08.2017	36 095 997		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-21.08.17 (Exp.17.08.17) on EUR/USD	EUR	1.00	21.07.2017	21.08.2017	36 095 996		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-21.08.17 (Exp.17.08.17) on USD/CHF	CHF	1.00	21.07.2017	21.08.2017	36 095 995		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on EUR/GBP	GBP	1.00	28.07.2017	21.08.2017	36 096 052		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
Reverse Convertible on EUR/USD	EUR	1.00	07.08.2017	21.08.2017	37 545 364		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
Reverse Convertible on EUR/CHF	CHF	1.00	07.08.2017	21.08.2017	37 545 356		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
Reverse Convertible on USD/MXN	MXN	1.00	14.08.2017	21.08.2017	37 545 404		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
Reverse Convertible on EUR/MXN	MXN	1.00	14.08.2017	21.08.2017	37 545 401		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
Reverse Convertible on EUR/MXN	MXN	1.00	14.08.2017	21.08.2017	37 545 405		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
Reverse Convertible on USD/MXN	MXN	1.00	14.08.2017	21.08.2017	37 545 400		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
Reverse Convertible on USD/MXN	MXN	1.00	14.08.2017	21.08.2017	37 545 406		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
Reverse Convertible on EUR/MXN	MXN	1.00	14.08.2017	21.08.2017	37 545 403		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
Reverse Convertible on USD/MXN	MXN	1.00	14.08.2017	21.08.2017	37 545 402		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
Reverse Convertible on EUR/USD	USD	1.00	14.08.2017	21.08.2017	37 545 399		-	100.000	100.000	21.08.	0.000	Y
Bonus Certificate on SMI	CHF	1'000.00	22.08.2014	22.08.2017	24 409 061		-	99.670	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on S&P 500	USD	1'000.00	22.08.2014	22.08.2017	24 409 060		-	96.770	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	22.08.2014	22.08.2017	24 409 059		-	98.840	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	USD	1'000.00	22.02.2016	22.08.2017	30 485 305		-	98.940	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	22.02.2016	22.08.2017	30 485 304		-	98.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on USD/CHF	USD	1.00	08.08.2017	22.08.2017	37 545 368		-	100.000	100.000	22.08.	0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	24.08.2015	24.08.2017	28 883 963		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	24.02.2016	24.08.2017	30 485 324		-	98.920	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	24.02.2016	24.08.2017	30 485 325		-	98.920	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Chevron	USD	1'000.00	24.08.2016	24.08.2017	32 219 552		-	100.000	100.000		0.000	N
Reverse Convertible on GBP/USD	USD	1.00	24.07.2017	24.08.2017	36 096 021		-	100.000	100.000	24.08.	0.000	Y
Reverse Convertible on EUR/USD	USD	1.00	24.07.2017	24.08.2017	36 096 019		-	100.000	100.000	24.08.	0.000	Y
Reverse Convertible on EUR/CHF	CHF	1.00	17.08.2017	24.08.2017	37 545 416		-	100.000	100.000	24.08.	0.000	Y
Reverse Convertible on EUR/CHF	CHF	1.00	17.08.2017	24.08.2017	37 545 417		-	100.000	100.000	24.08.	0.000	Y
Underlying Tracker on Engie	EUR	1'000.00	25.08.2015	25.08.2017	28 883 967		-	99.830	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 26.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	26.08.2015	28.08.2017	24 874 952		-	100.000	100.000	27.02. 26.05.	0.24012 0.24517	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	26.08.2015	28.08.2017	28 883 972		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Engie	USD	1'000.00	27.08.2015	28.08.2017	28 883 982		-	98.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.08.2015	28.08.2017	28 883 989		-	98.260	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Engie	EUR	1'000.00	27.08.2015	28.08.2017	28 883 981		-	99.830	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Engie	EUR	1'000.00	27.08.2015	28.08.2017	28 883 980		-	99.830	100.000		0.000	Y
4 % Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	28.08.2015	28.08.2017	28 845 371		-	100.000	100.000	28.02. 29.05. 28.08.	0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	26.02.2016	28.08.2017	30 485 333		-	100.000	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible on Equities 27.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung 27.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	27.05.2016	28.08.2017	31 883 796		-	100.000	100.000	 27.02. 27.02.	 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	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible 2017-28.08.17 (Exp.24.08.17) on USD/CHF	CHF	1.00	27.07.2017	28.08.2017	36 096 038		-	100.000	100.000		0.000	Y
Drop-Back-Cert. on Euro Stoxx 50-Index	EUR	1'000.00	29.08.2014	29.08.2017	24 903 182		-	98.930	100.000		0.000	Y
Drop-Back-Cert. on Euro Stoxx 50-Index	CHF	1'000.00	29.08.2014	29.08.2017	24 903 181		-	99.730	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Roche Hldg G	CHF	228.75	02.06.2016	31.08.2017	31 883 819		-	100.000	100.000		0.000	Y
4 3/4 % Reverse Convertible on Indices 1.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	01.09.2015	01.09.2017	24 874 936		-	100.000	100.000	01.03.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	01.09.2015	01.09.2017	28 884 005		-	98.420	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	01.09.2015	01.09.2017	28 884 001		-	100.000	100.000		0.000	Y
6 1/4 % Reverse Convertible on Indices 1.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	01.09.2015	01.09.2017	24 874 940		-	100.000	100.000	01.03.	4.186	N
4 7/8 % Reverse Convertible Called for red.on 01.03.17 at 100 % 1.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	01.09.2015	01.09.2017	24 874 938		-	100.000	100.000	01.03.	0.000	N
5 1/4 % Reverse Convertible Called for red.on 01.03.17 at 100 % 1.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung 1.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	01.03.2016	01.09.2017	30 012 937		-	100.000	100.000	01.03.	0.000	N
Bonus Certificates on Indices	CHF	1'000.00	02.09.2014	04.09.2017	24 409 226		-	99.760	100.000		0.000	Y
2 3/4 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	02.09.2015	04.09.2017	24 874 935		-	100.000	100.000	04.09.	0.000	N
7 1/4 % Reverse Convertible on Indices 2.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	02.09.2015	04.09.2017	28 884 022		-	100.000	100.000	02.03.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	03.09.2015	04.09.2017	28 884 032		-	100.000	100.000		0.000	Y
6 1/4 % Reverse Convertible on Equities 6.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	03.09.2015	04.09.2017	24 874 951		-	100.000	100.000	03.03. 06.06.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	04.09.2015	04.09.2017	28 884 040		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	04.09.2015	04.09.2017	28 884 041		-	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	04.03.2016	04.09.2017	30 012 941		-	100.000	100.000	06.03. 04.09.	0.000 0.000	N
10 % Reverse Convertible Called for Red 02.03.2017 at 100% 2.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	02.09.2016	04.09.2017	33 162 684		-	100.000	100.000	02.03.	0.000	N
Drop-Back-Cert. on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	02.09.2014	05.09.2017	24 903 160		-	96.570	100.000		0.000	Y
ProNotes floating rate	CHF	1'000.00	05.09.2014	05.09.2017	25 273 669		-	99.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-05.09.17 (Exp.01.09.17) on USD/NOK	NOK	1.00	02.06.2017	05.09.2017	36 095 709		-	100.000	100.000	05.09.	0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	07.09.2015	07.09.2017	28 884 049		-	99.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	07.03.2016	07.09.2017	30 012 950		-	100.000	100.000		0.000	Y
7 1/2 % Reverse Convertible Called for red. on 07.03.17 at 100 % 7.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.09.2016	07.09.2017	33 162 693		-	100.000	100.000	07.03.	0.000	N
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	08.09.2015	08.09.2017	28 884 057		-	99.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Repsol	EUR	1'000.00	08.09.2015	08.09.2017	28 884 066		-	99.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.991%	EUR	1'000.00	08.09.2015	08.09.2017	28 884 052		-	99.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	08.09.2015	08.09.2017	28 884 054		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	08.09.2015	08.09.2017	28 884 055		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	08.09.2015	08.09.2017	28 884 059		-	100.000	100.000		0.000	Y
Bonus Certificates on Equities	CHF	1'000.00	09.09.2014	11.09.2017	23 071 825		-	99.760	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	09.09.2015	11.09.2017	28 884 063		-	98.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 10.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.991%	EUR	1'000.00	10.09.2015	11.09.2017	28 884 079		-	99.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 10.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.991%	EUR	1'000.00	10.09.2015	11.09.2017	24 874 966		-	99.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	10.03.2016	11.09.2017	30 485 384		-	100.000	100.000		0.000	Y
7 1/4 % Reverse Convertible Called for red. on 10.03.17 at 100 % 10.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	10.03.2016	11.09.2017	30 012 960		-	100.000	100.000	10.03.	4.192	N
7 1/4 % Reverse Convertible on Equities 9.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	09.09.2016	11.09.2017	33 162 699		-	100.000	100.000	09.03.	2.434	N
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	14.09.2015	14.09.2017	28 884 084		-	99.840	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	14.09.2015	14.09.2017	28 884 082		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	14.09.2015	14.09.2017	28 884 081		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	14.09.2015	14.09.2017	28 884 083		-	99.840	100.000		0.000	Y
5 1/4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.09.2015	15.09.2017	24 874 967		-	100.000	100.000	15.03. 15.09.	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	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
7.1 % Reverse Convertible on Indices 20.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	18.03.2015	18.09.2017	24 874 690		-	100.000	100.000	20.03.	0.52832	N
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.09.2015	18.09.2017	28 884 097		-	98.280	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.09.2015	18.09.2017	28 884 096		-	98.280	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	18.09.2015	18.09.2017	24 874 972		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	16.03.2016	18.09.2017	30 485 404		-	98.740	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	16.03.2016	18.09.2017	30 485 406		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	16.03.2016	18.09.2017	30 485 402		-	100.000	100.000		0.000	Y
5 1/2 % Reverse Convertible Called for red. on 17.03.17 at 100 % 17.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	17.03.2016	18.09.2017	30 012 968		-	100.000	100.000	17.03.	0.000	N
Reverse Convertible on TevaPharmInd Sp ADR	USD	48.90	19.07.2016	19.09.2017	31 883 899		-	99.090	100.000		0.000	Y
4.1 % Barrier Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	20.03.2014	20.09.2017	23 071 349		-	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09.	2.616 2.561 2.524	N
3.05 % Barrier Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	20.03.2014	20.09.2017	23 071 347		-	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09.	0.575 0.575 0.575	N
3.55 % Barrier Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	20.03.2014	20.09.2017	23 071 348		-	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09.	1.741 1.764 1.874	N
Reverse Convertible 2017-21.09.17 (Exp.19.09.17) on EUR/CHF	EUR	1.00	14.09.2017	21.09.2017	37 545 559		-	100.000	100.000	21.09.	0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	22.03.2016	22.09.2017	30 485 421		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Axa	USD	1'000.00	22.03.2016	22.09.2017	30 485 425		-	98.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-22.09.17 (Exp.20.09.17) on USD/CHF	USD	1.00	15.09.2017	22.09.2017	37 545 578		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-22.09.17 (Exp.20.09.17) on EUR/CHF	EUR	1.00	15.09.2017	22.09.2017	37 545 576		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	25.09.2014	25.09.2017	24 439 503		-	96.350	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Axa	EUR	1'000.00	23.03.2016	25.09.2017	30 485 426		-	100.000	100.000		0.000	Y
5.9 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.09.2016	25.09.2017	33 162 727		-	100.000	100.000	23.03. 23.09.	0.000 0.000	N
2.25 % (4.5 % p.a.) Reverse Convertible on Hess Rg	USD	1'000.00	24.03.2017	25.09.2017	36 044 044		-	100.000	100.000	25.09.	7.020	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	26.09.2014	26.09.2017	24 439 516		-	96.170	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	26.03.2015	26.09.2017	25 232 583		-	97.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-27.09.17 (Exp.25.09.17) on EUR/CHF	CHF	1.00	20.09.2017	27.09.2017	37 545 600		-	100.000	100.000	27.09.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-27.09.17 (Exp.25.09.17) on EUR/MXN	EUR	1.00	20.09.2017	27.09.2017	37 545 610		-	100.000	100.000	27.09.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-27.09.17 (Exp.25.09.17) on USD/MXN	USD	1.00	20.09.2017	27.09.2017	37 545 609		-	100.000	100.000	27.09.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-27.09.17 (Exp.25.09.17) on EUR/MXN	EUR	1.00	20.09.2017	27.09.2017	37 545 608		-	100.000	100.000	27.09.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-27.09.17 (Exp.25.09.17) on USD/MXN	USD	1.00	20.09.2017	27.09.2017	37 545 607		-	100.000	100.000	27.09.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-27.09.17 (Exp.25.09.17) on EUR/MXN	EUR	1.00	20.09.2017	27.09.2017	37 545 606		-	100.000	100.000	27.09.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-27.09.17 (Exp.25.09.17) on USD/MXN	USD	1.00	20.09.2017	27.09.2017	37 545 605		-	100.000	100.000	27.09.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-27.09.17 (Exp.25.09.17) on USD/MXN	USD	1.00	20.09.2017	27.09.2017	37 545 611		-	100.000	100.000	27.09.	0.000	Y
7 % Reverse Convertible Called for red. on 28.03.17 at 100 % 28.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	28.09.2016	28.09.2017	33 162 730		-	100.000	100.000	28.03.	0.000	N
Reverse Convertible 2017-28.09.17 (Exp.26.09.17) on USD/CHF	USD	1.00	21.09.2017	28.09.2017	37 545 613		-	100.000	100.000	28.09.	0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	29.09.2014	29.09.2017	24 439 520		-	96.170	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	USD	1'000.00	29.09.2014	29.09.2017	24 439 521		-	96.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	29.09.2015	29.09.2017	28 884 125		-	99.850	100.000	29.09.		Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	29.09.2015	29.09.2017	28 884 127		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	30.09.2015	29.09.2017	28 884 129		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	30.09.2015	29.09.2017	28 884 128		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	30.09.2015	29.09.2017	28 884 130		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	30.03.2016	29.09.2017	30 485 434		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-29.09.17 (Exp.27.09.17) on USD/CHF	USD	1.00	15.09.2017	29.09.2017	37 545 579		-	100.000	100.000	29.09.	0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible 2017-29.09.17 (Exp.27.09.17) on EUR/USD	EUR	1.00	15.09.2017	29.09.2017	37 545 575		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-29.09.17 (Exp.27.09.17) on USD/CHF	USD	1.00	15.09.2017	29.09.2017	37 545 573		-	100.000	100.000	29.09.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-29.09.17 (Exp.27.09.17) on EUR/USD	USD	1.00	15.09.2017	29.09.2017	37 545 572		-	100.000	100.000	29.09.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-29.09.17 (Exp.27.09.17) on EUR/USD	USD	1.00	15.09.2017	29.09.2017	37 545 571		-	100.000	100.000	29.09.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-29.09.17 (Exp.27.09.17) on EUR/CHF	CHF	1.00	15.09.2017	29.09.2017	37 545 574		-	100.000	100.000	29.09.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-29.09.17 (Exp.27.09.17) on EUR/CHF	EUR	1.00	22.09.2017	29.09.2017	37 545 627		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-29.09.17 (Exp.27.09.17) on USD/CHF	USD	1.00	22.09.2017	29.09.2017	37 545 630		-	100.000	100.000	29.09.	0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	02.10.2014	02.10.2017	23 071 865		-	99.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	01.10.2015	02.10.2017	24 874 993		-	100.000	100.000		0.000	Y
7 1/4 % Reverse Convertible on Indices 3.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	02.10.2015	02.10.2017	28 884 135		-	100.000	100.000	03.04.	0.000	N
Reverse Convertible on GBP/USD	USD	1.00	29.03.2017	03.10.2017	36 095 100		-	100.000	100.000	03.10.	0.010	Y
Reverse Convertible 2017-03.10.17 (Exp.29.09.17) on EUR/CHF	CHF	1.00	21.09.2017	03.10.2017	37 545 619		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-03.10.17 (Exp.29.09.17) on EUR/CHF	CHF	1.00	21.09.2017	03.10.2017	37 545 618		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-04.10.17 (Exp.02.10.17) on EUR/USD	USD	1.00	20.09.2017	04.10.2017	37 545 601		-	100.000	100.000	04.10.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-05.10.17 (Exp.03.10.17) on USD/CHF	USD	1.00	21.09.2017	05.10.2017	37 545 616		-	100.000	100.000	05.10.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-05.10.17 (Exp.03.10.17) on EUR/CHF	CHF	1.00	28.09.2017	05.10.2017	37 545 682		-	100.000	100.000	05.10.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-05.10.17 (Exp.03.10.17) on USD/CHF	USD	1.00	28.09.2017	05.10.2017	37 545 686		-	100.000	100.000	05.10.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-05.10.17 (Exp.03.10.17) on EUR/CHF	CHF	1.00	28.09.2017	05.10.2017	37 545 687		-	100.000	100.000	05.10.	0.000	Y
3.05 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	06.10.2015	06.10.2017	28 884 137		-	100.000	100.000	06.10.	0.000	N
7 % Reverse Convertible Called for red.on 06.01.17 at 100% 6.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.07.2016	06.10.2017	31 883 856		-	100.000	100.000	06.01.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	06.07.2016	06.10.2017	32 219 396		-	100.000	100.000		0.000	Y
8 1/2 % Reverse Convertible on Equities 6.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	06.10.2016	06.10.2017	33 162 748		-	100.000	100.000	06.01. 06.04.	2.356 2.334	N
5 3/8 % Reverse Convertible on Equities 10.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	09.04.2015	09.10.2017	24 874 755		-	100.000	100.000	10.04.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	07.10.2015	09.10.2017	28 884 146		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	08.10.2015	09.10.2017	28 884 154		-	99.900	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	08.10.2015	09.10.2017	28 884 153		-	99.900	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	07.04.2016	09.10.2017	30 485 450		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	10.10.2014	10.10.2017	24 439 561		-	96.130	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Indices	USD	1'000.00	07.10.2015	10.10.2017	28 294 096		-	94.480	96.000		0.000	Y
8 1/4 % Reverse Convertible called for Red. on 12.01.17 at 100% 12.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	12.07.2016	12.10.2017	31 883 867		-	100.000	100.000	12.01.	0.000	N
8 % Reverse Convertible on Equities 12.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	12.10.2016	12.10.2017	33 162 757		-	100.000	100.000	12.01. 12.04.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible 2017-12.10.17 (Exp.10.10.17) on GBP/USD	GBP	1.00	21.09.2017	12.10.2017	37 545 614		-	100.000	100.000	12.10.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-12.10.17 (Exp.10.10.17) on EUR/USD	USD	1.00	28.09.2017	12.10.2017	37 545 684		-	100.000	100.000	12.10.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-12.10.17 (Exp.10.10.17) on EUR/USD	EUR	1.00	28.09.2017	12.10.2017	37 545 680		-	100.000	100.000	12.10.	0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	13.04.2016	13.10.2017	30 485 465		-	100.000	100.000		0.000	Y
4.2 % Reverse Convertible on Crude Oil Barrel	EUR	1'000.00	13.10.2016	13.10.2017	32 219 752		-	100.000	100.000	13.10.	0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	CHF	1'000.00	14.10.2014	16.10.2017	24 439 571		-	99.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	CHF	1'000.00	14.10.2014	16.10.2017	24 439 565		-	99.810	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	15.10.2014	16.10.2017	25 273 699		-	100.000	100.000	16.10.	0.500	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	15.10.2015	16.10.2017	28 884 169		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	15.10.2015	16.10.2017	24 875 011		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	15.10.2015	16.10.2017	28 884 168		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	15.04.2016	16.10.2017	30 485 474		-	98.830	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
12 % Reverse Convertible called for Red. on 16.01.17 at 100% 16.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	14.07.2016	16.10.2017	31 883 875		-	100.000	100.000	16.01.	0.000	N
7 1/2 % Reverse Convertible on Equities 17.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	15.07.2016	16.10.2017	31 883 880		-	100.000	100.000	17.01. 17.04. 17.07.	1.829 1.827 1.757	N
Reverse Convertible 2017-16.10.17 (Exp.12.10.17) on GBP/USD	GBP	1.00	15.09.2017	16.10.2017	37 545 570		-	100.000	100.000	16.10.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-16.10.17 (Exp.12.10.17) on EUR/USD	USD	1.00	15.09.2017	16.10.2017	37 545 577		-	100.000	100.000	16.10.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-16.10.17 (Exp.12.10.17) on EUR/CHF	EUR	1.00	15.09.2017	16.10.2017	37 545 569		-	100.000	100.000		0.000	Y
3.6 % Barrier Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	17.04.2014	17.10.2017	23 071 606		-	100.000	100.000	17.01. 17.04. 17.07. 17.10.	1.822 1.815 1.877 1.957	N
4.1 % Barrier Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	17.04.2014	17.10.2017	23 071 608		-	100.000	100.000	17.01. 17.04. 17.07. 17.10.	2.807 2.804 2.696 2.744	N
3.1 % Barrier Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	17.04.2014	17.10.2017	23 071 607		-	100.000	100.000	17.01. 17.04. 17.07. 17.10.	0.500 0.500 0.500 0.500	N
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	18.04.2016	18.10.2017	30 485 476		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	18.04.2016	18.10.2017	30 485 477		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-19.10.17 (Exp.17.10.17) on EUR/USD	USD	1.00	22.09.2017	19.10.2017	37 545 629		-	100.000	100.000	19.10.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-19.10.17 (Exp.17.10.17) on EUR/USD	USD	1.00	22.09.2017	19.10.2017	37 545 628		-	100.000	100.000	19.10.	0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	20.04.2016	20.10.2017	30 485 481		-	98.810	100.000		0.000	Y
7.45 % Reverse Convertible on Indices 20.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	20.04.2016	20.10.2017	30 013 004		-	100.000	100.000	20.04.	0.000	N
Reverse Convertible on Gold 1 Uz	EUR	1.00	20.01.2017	20.10.2017	34 646 536		-	100.000	100.000	20.10.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-20.10.17 (Exp.18.10.17) on EUR/USD	EUR	1.00	20.09.2017	20.10.2017	37 545 604		-	100.000	100.000	20.10.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-20.10.17 (Exp.18.10.17) on EUR/USD	EUR	1.00	20.09.2017	20.10.2017	37 545 603		-	100.000	100.000	20.10.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-20.10.17 (Exp.18.10.17) on USD/CHF	USD	1.00	20.09.2017	20.10.2017	37 545 602		-	100.000	100.000	20.10.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-20.10.17 (Exp.18.10.17) on EUR/GBP	GBP	1.00	20.09.2017	20.10.2017	37 545 599		-	100.000	100.000	20.10.	0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	23.10.2014	23.10.2017	25 273 708		-	97.060	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	22.04.2015	23.10.2017	24 874 738		-	100.000	100.000	22.04. 22.10.	4.350 4.308	N
6.4 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	22.04.2015	23.10.2017	24 874 736		-	100.000	100.000	24.04. 22.10.	0.000 0.000	N
7.1 % Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	22.04.2015	23.10.2017	24 874 737		-	100.000	100.000	22.04. 22.10.	0.41121 0.4403	N
Underlying Tracker on HS China Ent Index	USD	1'000.00	23.04.2015	23.10.2017	27 033 394		-	97.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	21.10.2015	23.10.2017	28 884 181		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	21.10.2015	23.10.2017	28 884 183		-	98.500	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	21.10.2015	23.10.2017	28 884 182		-	99.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	21.10.2015	23.10.2017	28 884 180		-	99.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.10.2015	23.10.2017	28 884 186		-	99.920	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible Called for red.on 23.01.17 at 100% 23.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	22.07.2016	23.10.2017	31 883 889		-	100.000	100.000	23.01.	0.000	N
Reverse Convertible 2017-23.10.17 (Exp.19.10.17) on USD/CHF	USD	1.00	21.07.2017	23.10.2017	36 096 016		-	100.000	100.000	23.10.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-23.10.17 (Exp.19.10.17) on EUR/CHF	EUR	1.00	21.09.2017	23.10.2017	37 545 617		-	100.000	100.000	23.10.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-23.10.17 (Exp.19.10.17) on EUR/NOK	NOK	1.00	21.09.2017	23.10.2017	37 545 620		-	100.000	100.000	23.10.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-23.10.17 (Exp.19.10.17) on EUR/CAD	CAD	1.00	21.09.2017	23.10.2017	37 545 623		-	100.000	100.000	23.10.	0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible 2017-23.10.17 (Exp.19.10.17) on EUR/CHF	EUR	1.00	21.09.2017	23.10.2017	37 545 622		-	100.000	100.000	23.10.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-23.10.17 (Exp.19.10.17) on AUD/CHF	AUD	1.00	21.09.2017	23.10.2017	37 545 621		-	100.000	100.000	23.10.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-23.10.17 (Exp.19.10.17) on EUR/USD	USD	1.00	21.09.2017	23.10.2017	37 545 615		-	100.000	100.000	23.10.	0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	24.10.2014	24.10.2017	24 409 224		-	99.140	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	24.10.2014	24.10.2017	24 409 223		-	99.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	24.10.2014	24.10.2017	24 439 486		-	96.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Gold 1 Kg	CHF	1.00	24.01.2017	24.10.2017	34 646 567		-	100.000	100.000	24.10.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-24.10.17 (Exp.20.10.17) on GBP/CHF	GBP	1.00	22.09.2017	24.10.2017	37 545 625		-	100.000	100.000	24.10.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-24.10.17 (Exp.20.10.17) on USD/CHF	USD	1.00	22.09.2017	24.10.2017	37 545 626		-	100.000	100.000	24.10.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.10.2015	26.10.2017	28 884 187		-	98.560	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	26.04.2016	26.10.2017	30 485 510		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	26.04.2016	26.10.2017	30 485 508		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	26.04.2016	26.10.2017	30 485 506		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	26.04.2016	26.10.2017	30 485 509		-	100.000	100.000		0.000	Y
7 1/2 % Reverse Convertible on Equities 26.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	26.07.2016	26.10.2017	31 883 891		-	100.000	100.000	26.01. 26.04. 26.07.	0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	27.10.2015	27.10.2017	28 884 195		-	99.940	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	CHF	1'000.00	27.10.2015	27.10.2017	24 875 021		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	27.10.2015	27.10.2017	24 875 022		-	98.530	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	27.04.2016	27.10.2017	30 485 513		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	27.04.2016	27.10.2017	30 485 512		-	98.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	27.04.2016	27.10.2017	30 485 511		-	98.780	100.000		0.000	Y
8 1/4 % Reverse Convertible Called for Red. on 27.01.17 at 100% 27.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	27.07.2016	27.10.2017	31 883 893		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	28.10.2015	30.10.2017	28 884 200		-	99.920	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	28.10.2015	30.10.2017	28 884 199		-	99.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.228%	USD	1'000.00	28.10.2015	30.10.2017	28 884 201		-	98.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 30.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.917%	USD	1'000.00	28.04.2016	30.10.2017	30 485 519		-	98.690	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	29.04.2016	30.10.2017	32 219 160		-	98.700	100.000		0.000	Y
10 1/4 % Reverse Convertible Called for red.on 30.01.17 at 100 % 30.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	29.07.2016	30.10.2017	31 883 898		-	100.000	100.000	30.01.	0.000	N
Reverse Convertible 2017-30.10.17 (Exp.26.10.17) on EUR/USD	USD	1.00	28.09.2017	30.10.2017	37 545 681		-	100.000	100.000	30.10.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-30.10.17 (Exp.26.10.17) on EUR/USD	USD	1.00	28.09.2017	30.10.2017	37 545 683		-	100.000	100.000	30.10.	0.000	Y
Protection Participation on Indices	USD	1'000.00	31.10.2016	31.10.2017	34 112 889		-	96.050	97.000		0.000	Y
6.73 % Reverse Convertible on Indices 2.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	02.11.2016	02.11.2017	32 219 878		-	100.000	100.000	02.02. 02.05.	0.000 0.000	N
8 % Reverse Convertible Called for Red. on 03.02.17 at 100% 3.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	03.08.2016	03.11.2017	31 883 902		-	100.000	100.000	03.02.	0.000	N
Underlying Tracker on Indices	CHF	1'000.00	04.11.2014	06.11.2017	23 071 901		-	99.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	05.11.2015	06.11.2017	28 884 212		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	05.11.2015	06.11.2017	28 884 211		-	98.500	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	06.11.2015	06.11.2017	28 884 219		-	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Indices 8.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.11.2015	06.11.2017	24 875 034		-	100.000	100.000	06.02. 08.05.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.05.2016	06.11.2017	32 219 180		-	98.710	100.000		0.000	Y
7.5 % Reverse Convertible on Indices 8.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.05.2016	06.11.2017	31 883 741		-	100.000	100.000	08.05.	0.000	N
7.25 % Reverse Convertible on Equities 5.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	05.08.2016	06.11.2017	31 883 906		-	100.000	100.000	06.02. 05.05.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on AUD/CHF	AUD	1.00	04.05.2017	06.11.2017	36 095 492		-	100.000	100.000	06.11.	0.00766	Y
Reverse Convertible on AUD/CHF	AUD	1.00	05.05.2017	06.11.2017	36 095 493		-	100.000	100.000	06.11.	0.00766	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
8 % Reverse Convertible on Equities 9.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	09.05.2016	09.11.2017	31 883 764		-	100.000	100.000	09.05.	0.000	N
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	09.05.2016	09.11.2017	32 219 184		-	100.000	100.000		0.000	Y
4.6 % Reverse Convertible on Indices 12.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	12.05.2015	13.11.2017	24 874 802		-	100.000	100.000	12.05.	0.000	N
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	11.11.2015	13.11.2017	28 884 226		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	11.11.2015	13.11.2017	24 875 039		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	11.11.2015	13.11.2017	28 884 234		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	12.11.2015	13.11.2017	28 884 238		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	12.11.2015	13.11.2017	28 884 237		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	13.11.2015	13.11.2017	28 884 248		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	11.05.2016	13.11.2017	32 219 191		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on UBS Group N	CHF	1'000.00	11.05.2016	13.11.2017	32 219 189		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SAP	EUR	1'000.00	14.11.2014	14.11.2017	24 874 591		-	99.220	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities 15.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	15.11.2016	15.11.2017	33 162 813		-	100.000	100.000	15.02. 15.05.	0.000 0.000	N
5.6 % Reverse Convertible on Indices 17.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	17.11.2015	17.11.2017	24 875 048		-	100.000	100.000	17.02. 17.05.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	17.05.2016	17.11.2017	32 219 209		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	18.11.2014	20.11.2017	24 439 745		-	96.620	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	19.11.2014	20.11.2017	24 439 748		-	96.620	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	GBP	1'000.00	20.11.2014	20.11.2017	25 273 726		-	96.230	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Indices 22.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	20.05.2015	20.11.2017	24 874 778		-	100.000	100.000	22.05.	4.960	N
Underlying Tracker on HS China Ent Index	USD	1'000.00	18.11.2015	20.11.2017	28 884 255		-	98.090	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	19.11.2015	20.11.2017	28 884 260		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	19.11.2015	20.11.2017	28 884 259		-	100.000	100.000		0.000	Y
3.70 % Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	21.11.2016	21.11.2017	34 112 901		-	100.000	100.000	22.05. 21.11.	0.000 0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities 23.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	23.08.2016	23.11.2017	33 162 664		-	100.000	100.000	23.02. 23.05.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	24.11.2014	24.11.2017	24 439 784		-	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	24.11.2014	24.11.2017	24 439 785		-	99.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.11.2015	24.11.2017	28 884 272		-	98.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.11.2015	24.11.2017	28 884 271		-	98.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.11.2015	24.11.2017	28 884 270		-	98.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.11.2015	24.11.2017	28 884 269		-	98.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.979%	USD	1'000.00	24.11.2015	24.11.2017	28 884 267		-	98.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.11.2015	24.11.2017	28 884 277		-	98.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.11.2015	24.11.2017	28 884 273		-	98.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.979%	USD	1'000.00	24.11.2015	24.11.2017	28 884 275		-	98.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.283%	USD	1'000.00	24.11.2015	24.11.2017	28 884 276		-	98.090	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	25.11.2014	27.11.2017	24 439 790		-	96.610	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Apple	USD	1'000.00	27.05.2015	27.11.2017	25 232 884		-	97.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.11.2015	27.11.2017	28 884 296		-	98.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on USD/CHF	CHF	1.00	26.05.2017	27.11.2017	36 095 672		-	100.000	100.000	27.11.	0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities 28.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	31.08.2016	30.11.2017	33 162 678		-	100.000	100.000	28.02.	0.000	N
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	01.12.2014	01.12.2017	24 439 806		-	96.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	01.12.2014	01.12.2017	24 439 809		-	99.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	03.12.2014	04.12.2017	25 273 742		-	96.740	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	03.12.2014	04.12.2017	24 439 821		-	96.640	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nikkei 225	USD	1'000.00	04.12.2014	04.12.2017	24 439 829		-	96.720	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible on Indices 2.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	02.12.2015	04.12.2017	24 875 062		-	100.000	100.000	02.03. 02.06.	0.000 0.000	N
4.85 % Reverse Convertible on Indices 2.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	02.12.2015	04.12.2017	24 875 063		-	100.000	100.000	02.06.	0.000	N
Underlying Tracker on SMI	USD	1'000.00	02.12.2015	04.12.2017	28 884 310		-	98.050	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5 3/4 % Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	03.12.2015	04.12.2017	24 875 065		-	100.000	100.000	03.03. 05.06.	2.526 2.411	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	04.12.2015	04.12.2017	30 485 029		-	100.000	100.000		0.000	Y
10.00 % Reverse Convertible on Equities 2.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	02.12.2016	04.12.2017	33 162 849		-	100.000	100.000	02.03. 02.06.	2.805 2.674	N
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	05.12.2014	05.12.2017	24 439 837		-	99.230	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	05.12.2014	05.12.2017	24 439 838		-	99.890	100.000		0.000	Y
7.25 % Reverse Convertible on Equities 6.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	05.09.2016	05.12.2017	33 162 685		-	100.000	100.000	06.03. 06.06.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	06.06.2016	06.12.2017	32 219 271		-	100.000	100.000		0.000	Y
10.25 % Reverse Convertible on Equities 6.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.09.2016	06.12.2017	33 162 692		-	100.000	100.000	06.03.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	07.06.2016	07.12.2017	32 219 272		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	08.06.2015	08.12.2017	25 232 951		-	97.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Airbus Group 8.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	08.12.2015	08.12.2017	30 485 031		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	11.12.2014	11.12.2017	25 273 740		-	96.600	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities 9.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	09.09.2016	11.12.2017	33 162 700		-	100.000	100.000	09.03.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	13.06.2016	13.12.2017	32 219 290		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2017-13.12.17 (Exp.11.12.17) on EUR/GBP	GBP	1.00	20.09.2017	13.12.2017	37 545 598		-	100.000	100.000	13.12.	0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	14.12.2015	14.12.2017	30 485 043		-	100.000	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities 14.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	14.12.2016	14.12.2017	34 468 404		-	100.000	100.000	14.03. 14.06.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Indices	CHF	1'000.00	15.12.2014	15.12.2017	24 439 815		-	99.940	100.000		0.000	Y
8.75 % Reverse Convertible on Equities 15.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	15.06.2016	15.12.2017	31 883 827		-	100.000	100.000	15.06.	0.000	N
10 % Reverse Convertible on Equities 15.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	15.09.2016	15.12.2017	33 162 709		-	100.000	100.000	15.03.	0.000	N
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	16.06.2015	18.12.2017	25 232 963		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	17.12.2015	18.12.2017	30 485 052		-	100.000	100.000		0.000	Y
6.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.12.2015	18.12.2017	30 012 844		-	100.000	100.000	19.06. 18.12.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	16.06.2016	18.12.2017	32 219 300		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	16.06.2016	18.12.2017	32 219 301		-	100.000	100.000		0.000	Y
10.5 % Reverse Convertible on Equities 16.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	16.12.2016	18.12.2017	34 468 409		-	100.000	100.000	16.03. 16.06.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on XAU/CHF	CHF	1.00	18.01.2017	18.12.2017	34 646 510		-	100.000	100.000	18.12.	0.000	Y
Reverse Convertible on EUR/CHF	CHF	1.00	18.01.2017	18.12.2017	34 646 508		-	100.000	100.000	18.12.	0.000	Y
Reverse Convertible on EUR/USD	USD	1.00	16.06.2017	18.12.2017	36 095 789		-	100.000	100.000	18.12.	0.010	Y
10.77 % Reverse Convertible on Equities 19.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	19.12.2016	19.12.2017	32 220 142		-	100.000	100.000	20.03. 19.06.	0.000 0.000	N
4.85 % Structure Note credit linked on Glencore International AG	CHF	100'000.00	29.12.2015	20.12.2017	30 112 537		-	100.000	100.000	20.12.	4'850.00	N
Reverse Convertible 2017-20.12.17 (Exp.18.12.17) on AUD/CAD	AUD	1.00	20.09.2017	20.12.2017	37 545 612		-	100.000	100.000	20.12.	0.000	Y
Reverse Convertible 2017-21.12.17 (Exp.19.12.17) on EUR/JPY	JPY	1.00	28.09.2017	21.12.2017	37 545 685		-	100.000	100.000	21.12.	0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	22.06.2016	22.12.2017	32 219 330		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	24.06.2016	26.12.2017	32 219 345		-	98.850	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible Called for Red. on 27.03.17 at 100% 27.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.09.2016	27.12.2017	33 162 728		-	100.000	100.000	27.03.	0.000	N
8.01 % Reverse Convertible on Indices 30.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	27.12.2016	27.12.2017	34 906 031		-	100.000	100.000	27.01. 27.02. 27.03. 27.04. 30.05.	0.95654 0.9637 0.94239 0.95321 0.93466	N
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	28.06.2016	28.12.2017	32 219 352		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	28.06.2016	28.12.2017	32 219 351		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	28.06.2016	28.12.2017	32 219 355		-	98.790	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
11 % Reverse Convertible on Equities 28.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	28.12.2016	28.12.2017	34 468 426		-	100.000	100.000	28.03. 28.06. 28.09.	0.000 0.000 0.000	N
3.84 % Reverse Convertible on Basket 29.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.12.2014	29.12.2017	24 439 827		-	100.000	100.000	29.06.	0.200	N
4.08 % Reverse Convertible on Basket 29.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	11.12.2014	29.12.2017	24 439 828		-	100.000	100.000	29.06.	1.421	N
Reverse Convertible on Equities 29.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.837%	USD	1'000.00	29.12.2015	29.12.2017	30 485 075		-	97.840	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	29.06.2016	29.12.2017	32 219 358		-	98.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on IBEX 35	EUR	1'000.00	01.07.2016	02.01.2018	32 219 366	CHF	1511.720	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on IBEX 35	EUR	1'000.00	01.07.2016	02.01.2018	32 219 365	CHF	1527.780	100.000	100.000		0.000	Y
7.25 % Reverse Convertible on Equities 4.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	04.10.2016	04.01.2018	33 162 744		-	100.000	100.000	04.01. 04.04.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	05.07.2016	05.01.2018	32 219 385	CHF	1488.610	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	05.07.2016	05.01.2018	32 219 374	CHF	1229.800	98.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	05.07.2016	05.01.2018	32 219 384	CHF	1493.980	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	06.07.2016	08.01.2018	32 219 394	CHF	1297.360	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	07.07.2016	08.01.2018	32 219 402	CHF	1335.340	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on EUR/USD	EUR	1.00	10.04.2017	10.01.2018	36 095 216	%	91.240	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	12.01.2016	12.01.2018	30 485 090	CHF	1099.890	100.000	100.000		0.000	Y
8.5 % Reverse Convertible on Indices 12.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	12.10.2016	12.01.2018	32 830 114		-	100.000	100.000	12.01. 12.04.	2.394 2.386	N
4.05 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.01.2015	15.01.2018	24 439 915	%	99.200	100.000	100.000	16.01. 14.07.	0.000 0.000	N
6.3 % Reverse Convertible on Indices 17.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	15.07.2015	15.01.2018	24 874 853		-	100.000	100.000	16.01. 17.07.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	14.01.2016	15.01.2018	30 485 110	CHF	914.900	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	15.07.2016	15.01.2018	32 219 423	CHF	1867.590	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities 13.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	13.10.2016	15.01.2018	33 162 759		-	100.000	100.000	13.01. 13.04.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	16.01.2015	16.01.2018	24 874 648	CHF	837.500	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.045%	USD	1'000.00	15.01.2016	16.01.2018	30 485 122		-	97.870	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	14.10.2016	16.01.2018	32 219 785	CHF	1394.140	98.770	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	18.01.2016	18.01.2018	30 485 127	CHF	1352.200	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	18.01.2016	18.01.2018	30 485 128		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	19.01.2016	19.01.2018	30 485 144	CHF	670.560	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	19.01.2016	19.01.2018	30 485 147	CHF	1660.450	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	19.01.2016	19.01.2018	30 485 146	CHF	670.560	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	19.01.2016	19.01.2018	30 485 135	CHF	1342.960	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	19.01.2016	19.01.2018	30 485 143	CHF	1140.120	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	19.01.2016	19.01.2018	30 485 148	CHF	1661.220	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	20.01.2016	22.01.2018	30 485 152	CHF	893.450	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	20.01.2016	22.01.2018	30 012 871	CHF	1237.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	20.01.2016	22.01.2018	30 485 153	CHF	1250.140	100.000	100.000		0.000	Y
0 % Reverse Convertible on Commodities 23.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	21.01.2016	22.01.2018	30 485 184		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	21.01.2016	22.01.2018	30 485 156	CHF	1112.430	98.000	100.000		0.000	Y
0 % Reverse Convertible on Commodities 23.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	21.01.2016	22.01.2018	30 485 183		-	100.000	100.000		0.000	Y
0 % Reverse Convertible on Commodities 23.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.92%	USD	1'000.00	21.01.2016	22.01.2018	30 485 182		-	98.110	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	20.10.2016	22.01.2018	32 219 816	CHF	1428.020	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	26.01.2016	26.01.2018	30 485 209	CHF	1105.730	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	26.01.2016	26.01.2018	30 485 203	CHF	1540.520	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.215%	USD	1'000.00	26.07.2016	26.01.2018	32 219 445		-	98.750	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	29.01.2016	29.01.2018	30 485 233	CHF	1546.030	98.240	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	29.01.2016	29.01.2018	30 485 232	CHF	1558.010	98.240	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
10 % Reverse Convertible on Equities 27.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	27.10.2016	29.01.2018	33 162 782		-	100.000	100.000	27.01. 27.04.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on EUR/CAD	CAD	1.00	27.07.2017	29.01.2018	36 096 041	%	102.330	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on EUR/CAD	CAD	1.00	27.07.2017	29.01.2018	36 096 043	%	102.130	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	31.10.2016	31.01.2018	32 219 858	CHF	1104.500	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 1.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.939%	USD	1'000.00	01.02.2016	01.02.2018	30 485 237		-	98.150	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	01.02.2016	01.02.2018	30 485 235	CHF	1300.890	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	01.11.2016	01.02.2018	32 219 874	CHF	1401.130	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.02.2016	02.02.2018	30 485 251	CHF	835.480	98.150	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	02.02.2016	02.02.2018	30 485 243	CHF	1726.210	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	02.02.2016	02.02.2018	30 485 244	CHF	1473.540	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	02.02.2016	02.02.2018	30 485 246	CHF	1519.970	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.02.2016	02.02.2018	30 485 252	CHF	1589.420	98.150	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	02.02.2016	02.02.2018	30 485 247	CHF	1160.450	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Microsoft	USD	41.16	05.02.2015	05.02.2018	24 874 682	CHF	82.480	96.940	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	04.02.2016	05.02.2018	30 485 260	CHF	1150.820	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	EUR	1'000.00	05.02.2016	05.02.2018	30 485 264	CHF	1334.830	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	05.02.2016	05.02.2018	30 485 265	CHF	1137.400	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	05.02.2016	05.02.2018	30 485 261	CHF	1150.440	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	08.02.2016	08.02.2018	30 485 266	CHF	1186.110	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	09.02.2016	09.02.2018	30 485 270	CHF	1142.250	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	10.02.2015	12.02.2018	25 232 329	CHF	1111.900	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	12.02.2015	12.02.2018	26 574 162	CHF	1094.330	96.860	100.000		0.000	Y
9 % Reverse Convertible on Equities 11.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.11.2016	12.02.2018	33 162 810		-	100.000	100.000	13.02. 11.05.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on AUD/CHF	AUD	1.00	10.08.2017	12.02.2018	37 545 385	%	101.820	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on USD/CHF	USD	1.00	10.08.2017	12.02.2018	37 545 384	%	101.050	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on USD/CHF	USD	1.00	10.08.2017	12.02.2018	37 545 383	%	101.050	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on EUR/USD	EUR	1.00	17.02.2017	14.02.2018	34 646 756	%	91.530	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	16.02.2015	16.02.2018	24 874 680	CHF	1189.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	USD	1'000.00	16.08.2016	16.02.2018	32 219 516	CHF	1112.110	98.560	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Indices 21.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.08.2015	19.02.2018	24 874 888		-	100.000	100.000	20.02. 21.08.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	17.08.2016	19.02.2018	32 219 523	CHF	1440.820	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	22.02.2016	22.02.2018	30 485 303	CHF	1194.490	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	23.02.2016	23.02.2018	30 485 309	CHF	1541.520	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	23.02.2016	23.02.2018	30 485 313	CHF	1477.340	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	23.02.2016	23.02.2018	30 485 311	CHF	1190.820	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	23.02.2016	23.02.2018	30 485 319	CHF	1380.850	98.470	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	23.02.2016	23.02.2018	30 485 310	CHF	1452.910	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	23.08.2016	23.02.2018	32 219 542	CHF	1351.900	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	23.08.2016	23.02.2018	32 219 540	CHF	1345.200	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 24.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.907%	USD	1'000.00	24.02.2015	26.02.2018	25 232 414		-	96.360	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	USD	1'000.00	26.02.2015	26.02.2018	27 033 332	CHF	1122.590	96.370	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	26.02.2015	26.02.2018	27 033 329	CHF	1072.890	96.110	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Axa	EUR	1'000.00	25.02.2016	26.02.2018	30 485 331	CHF	1445.310	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 27.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.164%	USD	1'000.00	25.08.2016	26.02.2018	32 219 557		-	98.610	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	26.08.2016	26.02.2018	32 219 559	CHF	1153.210	100.000	100.000		0.000	Y
9.50 % Reverse Convertible on Equities 30.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.11.2016	28.02.2018	33 162 839		-	100.000	100.000	28.02. 30.05.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Indices 2.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.931%	USD	1'000.00	02.03.2015	02.03.2018	25 232 445		-	96.380	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	CHF	1'000.00	02.03.2015	02.03.2018	25 232 442	CHF	1017.490	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	02.03.2016	02.03.2018	30 485 345	CHF	1204.260	98.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 5.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	03.03.2015	05.03.2018	25 232 456		-	96.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 5.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	03.03.2015	05.03.2018	25 232 459		-	96.510	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 5.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	03.03.2015	05.03.2018	25 232 457		-	96.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 5.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	03.03.2015	05.03.2018	25 232 460		-	96.510	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	05.03.2015	05.03.2018	27 033 339	CHF	1045.610	96.540	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	USD	1'000.00	05.03.2015	05.03.2018	27 033 340	CHF	1113.820	96.540	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	05.09.2016	05.03.2018	32 219 590	CHF	1096.610	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Linde	EUR	1'000.00	05.09.2016	05.03.2018	32 219 586	CHF	1388.060	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 6.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.03.2015	06.03.2018	24 874 717		-	99.999	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.09.2016	06.03.2018	32 219 591	%	80.540	98.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on The Swatch Grp	CHF	1'000.00	07.03.2016	07.03.2018	30 485 360	CHF	1150.300	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ABB N	CHF	1'000.00	07.03.2016	07.03.2018	30 485 361	CHF	1461.260	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on VMware-A	USD	1'000.00	07.03.2016	07.03.2018	30 485 358	CHF	2385.240	98.360	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	07.03.2016	07.03.2018	30 485 362	CHF	1403.240	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	07.03.2016	07.03.2018	30 485 354	CHF	1418.120	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Schlumberger	USD	1'000.00	07.03.2016	07.03.2018	30 485 363	CHF	1053.000	98.360	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Telefonica	EUR	1'000.00	07.03.2016	07.03.2018	30 485 359	CHF	1403.870	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	07.09.2016	07.03.2018	32 219 603	CHF	1353.690	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	07.09.2016	07.03.2018	32 219 598	CHF	1108.080	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	08.03.2016	08.03.2018	30 485 371	CHF	1531.910	100.000	100.000		0.000	Y
Structured Note	USD	1'000.00	10.03.2015	12.03.2018	27 033 338	%	98.700	96.480	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	GBP	1'000.00	12.03.2015	12.03.2018	27 033 337	CHF	1399.980	96.260	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	USD	1'000.00	12.03.2015	12.03.2018	27 033 349	CHF	1106.020	96.310	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	CHF	1'000.00	11.09.2015	12.03.2018	24 874 965	CHF	1202.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Axa	EUR	1'000.00	11.03.2016	12.03.2018	30 485 390	CHF	1379.090	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	12.09.2016	12.03.2018	32 219 619	CHF	1180.330	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	12.09.2016	12.03.2018	32 219 618	CHF	1375.780	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	13.03.2015	13.03.2018	27 033 350	CHF	992.010	96.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	13.03.2015	13.03.2018	27 033 351	CHF	1011.500	96.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	1'000.00	13.03.2015	13.03.2018	25 232 527	CHF	1091.000	99.999	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	14.03.2016	14.03.2018	30 485 395	CHF	1219.360	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	14.03.2016	14.03.2018	30 485 394	CHF	1119.430	100.000	100.000		0.000	Y
10.25 % Reverse Convertible on Equities 15.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	15.12.2016	15.03.2018	34 468 406		-	100.000	100.000	15.03. 15.06.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Bayer N	EUR	81.00	15.12.2016	15.03.2018	34 468 424	CHF	104.310	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	16.03.2015	16.03.2018	25 232 483	%	101.240	99.600	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	16.03.2015	16.03.2018	27 033 353	%	94.700	94.570	95.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	16.06.2015	16.03.2018	25 233 003	CHF	1348.140	99.340	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	19.03.2015	19.03.2018	27 033 358	CHF	989.090	96.140	100.000		0.000	Y
(no min.) Credit Linked Notes Credit Linked on AEVIS Holding	CHF	5'000.00	09.02.2015	20.03.2018	25 273 753	%	98.950	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	16.390 16.890 16.860 16.730	N
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	1'000.00	20.03.2015	20.03.2018	24 874 730	CHF	1100.000	99.999	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	20.03.2015	20.03.2018	27 033 344	CHF	999.810	96.260	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	20.03.2015	20.03.2018	27 033 362	CHF	985.190	96.260	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	20.09.2016	20.03.2018	32 219 659	CHF	1179.530	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	22.03.2016	22.03.2018	30 485 423	CHF	1223.390	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	23.03.2015	23.03.2018	27 033 356	CHF	985.190	96.280	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	23.09.2016	23.03.2018	32 219 680	CHF	1442.030	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	26.03.2015	26.03.2018	27 033 370	CHF	996.880	96.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Tesla Motors	USD	1'000.00	24.03.2016	26.03.2018	30 485 430	%	144.300	98.170	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	24.03.2016	26.03.2018	30 485 428	CHF	1251.220	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	27.03.2015	27.03.2018	25 232 589	CHF	1231.730	96.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	27.03.2015	27.03.2018	25 232 561	%	101.280	99.610	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	27.03.2015	27.03.2018	24 874 741	%	100.110	100.000	100.000	27.03. 27.06. 27.09. 27.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	27.09.2016	27.03.2018	32 219 692	CHF	1433.780	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.03.2016	28.03.2018	30 485 436	CHF	1487.010	98.180	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	28.09.2016	28.03.2018	32 219 701	CHF	1504.140	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
3.85 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	30.03.2015	29.03.2018	25 232 591		-	100.000	100.000	30.03. 30.06.	9.625 9.625	N
30.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Underlying Tracker on Indices	CHF	1'000.00	29.09.2015	29.03.2018	24 874 988	CHF	1204.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	CHF	1'000.00	29.03.2016	29.03.2018	30 012 978	CHF	1222.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	30.09.2016	29.03.2018	32 219 731	CHF	1187.840	100.000	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	31.03.2017	29.03.2018	35 765 728	%	-	100.000	100.000	30.06. 29.12.	0.000 0.000	N
29.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung										29.12.	0.000	
29.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
7.5 % (8.4906 % p.a.) Reverse Convertible on Crude Oil	USD	1'000.00	11.05.2017	29.03.2018	36 453 988	%	100.100	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	30.03.2015	30.03.2018	25 232 597	%	100.680	96.590	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	02.04.2015	02.04.2018	25 232 615	%	101.030	96.680	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	01.04.2015	03.04.2018	27 033 377	%	101.700	96.970	100.000		0.000	Y
8.5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.01.2017	03.04.2018	34 468 432		-	100.000	100.000	03.04. 03.07.	3.184 3.057	N
3.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	04.10.2016	04.04.2018	32 219 743	CHF	1194.570	98.570	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	06.04.2016	06.04.2018	30 485 446	CHF	1273.840	100.000	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	07.04.2015	09.04.2018	24 874 752	%	100.210	100.000	100.000	09.01. 07.04. 07.07. 09.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	GBP	1'000.00	09.04.2015	09.04.2018	27 033 372	CHF	1340.660	96.940	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	09.04.2015	09.04.2018	27 033 378	CHF	991.040	96.570	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	09.04.2015	09.04.2018	27 033 371	CHF	988.110	96.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Halliburton	USD	1'000.00	07.04.2016	09.04.2018	30 485 451	%	124.700	98.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Mket Vect Gld Min	USD	1'000.00	07.04.2016	09.04.2018	30 485 452	%	139.400	98.280	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	12.04.2016	12.04.2018	30 485 460	CHF	1339.430	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	12.04.2016	12.04.2018	30 485 463	CHF	1362.670	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	12.04.2016	12.04.2018	30 485 459	CHF	1188.670	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	12.04.2016	12.04.2018	30 485 461	CHF	1161.060	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	13.04.2015	13.04.2018	25 232 638	%	101.100	96.770	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	15.04.2015	16.04.2018	24 874 769	%	101.560	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	15.04.2016	16.04.2018	30 485 471	CHF	1142.370	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	15.04.2016	16.04.2018	30 485 470	CHF	1408.770	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	15.04.2016	16.04.2018	30 485 469	CHF	1470.450	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.10.2016	17.04.2018	32 219 792	CHF	1603.240	98.470	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.10.2016	19.04.2018	33 162 763		-	100.000	100.000	19.04. 19.10.	0.000 0.000	N
19.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
19.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	88.25	20.10.2015	20.04.2018	28 884 179	CHF	81.170	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	20.04.2016	20.04.2018	30 485 482	CHF	1390.100	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	20.04.2016	20.04.2018	30 485 483	CHF	542.140	98.290	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.10.2016	20.04.2018	33 162 771		-	100.000	100.000	20.01. 20.04. 20.07. 20.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
20.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
20.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	20.10.2016	20.04.2018	32 219 823	CHF	1121.470	100.000	100.000		0.000	Y
3.15 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	21.04.2015	23.04.2018	24 874 761	%	100.380	100.000	100.000	23.01. 21.04. 21.07. 23.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker on SMI	USD	1'000.00	23.04.2015	23.04.2018	27 033 396	CHF	993.960	96.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	23.04.2015	23.04.2018	27 033 402	CHF	970.570	96.940	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on iShs MSCI Br Cp	USD	1'000.00	25.04.2016	25.04.2018	30 485 505	CHF	1405.670	98.270	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	27.04.2016	27.04.2018	30 485 518	CHF	1108.130	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	29.04.2015	30.04.2018	24 874 793		-	99.730	100.000		0.000	Y
30.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.96%												
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	29.04.2015	30.04.2018	25 232 763	%	101.220	96.710	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	30.04.2015	30.04.2018	27 187 909	CHF	1046.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	30.04.2015	30.04.2018	27 187 910	CHF	1258.040	96.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	GBP	1'000.00	30.04.2015	30.04.2018	27 033 412	CHF	1323.520	96.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.04.2016	30.04.2018	32 219 165	%	46.500	98.130	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	29.04.2016	30.04.2018	30 013 026	%	100.770	100.000	100.000	28.04.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	28.10.2016	30.04.2018	32 219 854	CHF	1099.630	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	28.10.2016	30.04.2018	32 219 855	CHF	1172.420	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.14%	USD	1'000.00	01.11.2016	01.05.2018	32 219 870		-	98.470	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	01.02.2017	02.05.2018	34 906 340	CHF	1169.540	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.02.2017	02.05.2018	34 906 360	CHF	1382.720	98.380	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	04.05.2015	04.05.2018	27 033 397	CHF	974.470	96.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	05.05.2015	07.05.2018	25 232 778	%	101.000	96.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	06.05.2015	07.05.2018	25 232 758	%	102.580	99.720	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	06.05.2016	07.05.2018	32 219 168	CHF	1179.190	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 7.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.835%	USD	1'000.00	07.11.2016	07.05.2018	32 219 861		-	98.470	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.11.2016	07.05.2018	32 219 896	CHF	1419.630	98.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	08.05.2015	08.05.2018	25 232 793	CHF	1178.960	99.650	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	09.02.2017	09.05.2018	34 906 453	CHF	1277.240	100.000	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.05.2017	09.05.2018	35 765 801	%	99.120	100.000	100.000	09.08. 09.11.	3.356 3.468	N
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	10.11.2016	10.05.2018	32 219 913	CHF	1546.430	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.11.2016	10.05.2018	32 219 906	%	97.630	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 11.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.739%	USD	1'000.00	11.02.2015	11.05.2018	25 232 345		-	96.540	100.000		0.000	Y
Structured Note	USD	1'000.00	11.05.2015	11.05.2018	28 012 768	%	96.200	92.630	96.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	11.05.2015	11.05.2018	28 012 767	CHF	954.980	96.480	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	10.11.2016	11.05.2018	32 219 908	CHF	1138.440	100.000	100.000		0.000	Y
5 1/4 % Barrier Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	12.05.2014	14.05.2018	23 071 668	%	74.610	100.000	100.000	12.05.	2.500	N
Reverse Convertible on Indices 12.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	12.05.2015	14.05.2018	25 232 813	%	100.700	96.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	13.05.2015	14.05.2018	28 012 756	%	98.300	96.740	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	14.05.2015	14.05.2018	28 012 772	CHF	1052.430	96.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 15.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.183%	GBP	1'000.00	15.05.2015	15.05.2018	25 232 817	%	100.500	96.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 15.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.969%	JPY	100'000.00	15.05.2015	15.05.2018	25 232 814		-	99.490	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	15.05.2015	15.05.2018	24 874 797	CHF	1132.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on BBVA	EUR	1'000.00	16.11.2016	16.05.2018	32 219 931	CHF	1377.480	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on IBEX 35	EUR	1'000.00	16.11.2016	16.05.2018	32 219 925	CHF	1333.090	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 17.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.241%	USD	1'000.00	17.05.2016	17.05.2018	32 219 212		-	98.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 17.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.21%	USD	1'000.00	17.11.2016	17.05.2018	32 219 929		-	98.490	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Indices 18.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.05.2015	18.05.2018	25 232 836		-	100.000	100.000	20.02. 18.05.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	18.11.2016	18.05.2018	32 219 949	CHF	1076.870	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 19.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.482%	USD	1'000.00	19.02.2015	21.05.2018	25 232 395		-	95.860	100.000		0.000	Y
ReverseConvertible on Index-Basket 22.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.415%	USD	1'000.00	20.05.2015	21.05.2018	24 874 826		-	96.510	100.000		0.000	Y
ReverseConvertible on Index-Basket 22.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.867%	EUR	1'000.00	20.05.2015	21.05.2018	24 874 827		-	99.430	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	21.05.2015	21.05.2018	28 012 760	CHF	1006.630	96.480	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	21.05.2015	21.05.2018	28 012 759	CHF	1215.780	99.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 21.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.195%	USD	1'000.00	19.05.2016	21.05.2018	32 219 222		-	98.250	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 22.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	20.05.2016	21.05.2018	32 219 225		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	22.05.2015	22.05.2018	25 232 870	%	100.400	96.740	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 22.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.432%	USD	1'000.00	22.05.2015	22.05.2018	25 232 865		-	96.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on EURO STOOXX 50-Index	EUR	1'000.00	22.05.2015	22.05.2018	28 012 758	%	98.700	99.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	22.05.2015	22.05.2018	25 232 869	%	100.400	96.740	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	22.05.2015	22.05.2018	28 012 784	CHF	987.140	96.660	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	22.11.2016	22.05.2018	32 219 961	CHF	1040.030	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	21.11.2017	22.05.2018	38 487 039	CHF	992.470	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	23.05.2016	23.05.2018	32 219 223	CHF	1209.200	100.000	100.000		0.000	Y
7.50 % Reverse Convertible on Equities 23.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	23.11.2016	23.05.2018	33 162 825		-	100.000	100.000	23.05. 23.11.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	23.11.2016	23.05.2018	32 219 971	CHF	1065.570	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	23.02.2017	23.05.2018	34 906 640	CHF	1186.960	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	24.11.2016	24.05.2018	32 219 990	CHF	1130.920	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	24.11.2016	24.05.2018	32 219 992	CHF	1125.220	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 29.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.869%	EUR	1'000.00	27.05.2015	28.05.2018	25 232 861		-	99.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	26.05.2015	29.05.2018	25 232 871	%	100.750	96.670	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	27.05.2015	29.05.2018	25 232 907	%	100.200	96.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	27.05.2015	29.05.2018	25 232 885	%	100.100	96.540	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	28.05.2015	29.05.2018	25 232 898	%	101.130	96.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	29.05.2015	29.05.2018	28 012 788	CHF	947.180	96.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	29.05.2015	29.05.2018	25 232 912	%	102.100	99.490	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	29.11.2016	29.05.2018	32 220 016	CHF	1093.100	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on AUD/CAD	AUD	1.00	27.11.2017	29.05.2018	37 546 062	%	99.710	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	30.11.2016	30.05.2018	32 220 027		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	31.05.2016	31.05.2018	32 219 255	CHF	1179.280	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	01.06.2016	01.06.2018	32 219 261	CHF	1337.610	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	01.06.2016	01.06.2018	32 219 262	CHF	1172.230	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities 1.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	01.06.2016	01.06.2018	31 883 799		-	100.000	100.000	01.03. 01.06.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	01.06.2016	01.06.2018	32 219 260	CHF	1338.070	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Eli Lilly & Co	USD	1'000.00	01.12.2016	01.06.2018	32 220 029	CHF	1280.730	98.250	100.000		0.000	Y
8.00 % Reverse Convertible on Equities 1.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	01.12.2016	01.06.2018	33 162 844		-	100.000	100.000	01.06. 01.12.	0.000 0.000	N
8 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.06.2017	01.06.2018	35 765 849	%	98.920	100.000	100.000	01.09. 01.12.	3.296 3.370	N
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	04.06.2015	04.06.2018	25 232 936	%	101.770	96.390	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 2.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.362%	USD	1'000.00	02.12.2015	04.06.2018	28 884 316		-	97.260	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nikkei 225	USD	1'000.00	03.12.2015	04.06.2018	28 884 322	CHF	1105.630	97.260	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	02.12.2016	04.06.2018	32 220 050	CHF	1134.080	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	02.12.2016	04.06.2018	32 220 049		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	06.06.2016	06.06.2018	32 219 270	CHF	1155.930	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	06.12.2016	06.06.2018	32 220 074	CHF	1155.370	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible Called for red. on 06.12.17 at 100% 6.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.12.2016	06.06.2018	33 162 857		-	100.000	100.000	06.03. 06.06. 06.09. 06.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
8.25 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.06.2017	07.06.2018	35 765 861	%	90.450	100.000	100.000	07.09. 07.12.	0.000 0.000	N
3 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	08.06.2015	08.06.2018	24 874 836	%	100.500	100.000	100.000	08.03. 08.06. 08.09. 08.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	08.06.2016	08.06.2018	32 219 276	CHF	1125.550	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	08.03.2017	08.06.2018	34 906 833	CHF	1048.220	98.270	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	10.06.2016	11.06.2018	32 219 284	CHF	1884.860	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	09.12.2016	11.06.2018	32 220 089	CHF	1152.160	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	09.12.2016	11.06.2018	32 220 091	CHF	1415.650	98.190	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	12.06.2015	12.06.2018	28 012 804	CHF	1013.450	96.090	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	12.06.2015	12.06.2018	28 012 803	CHF	1225.140	99.280	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Sanofi	EUR	1'000.00	12.12.2016	12.06.2018	32 220 093	CHF	1158.150	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on AUD/CHF	AUD	1.00	11.12.2017	12.06.2018	37 546 154	%	101.060	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	13.06.2016	13.06.2018	32 219 287	CHF	1294.810	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	13.06.2016	13.06.2018	32 219 288	CHF	1295.130	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur GrpN	CHF	1'000.00	13.06.2016	13.06.2018	32 219 286	CHF	1212.010	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities 13.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	13.12.2016	13.06.2018	34 468 399		-	100.000	100.000	13.06. 13.12.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Daimler N	EUR	1'000.00	13.12.2016	13.06.2018	32 220 099	CHF	1289.660	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.12.2016	13.06.2018	32 220 109	CHF	1232.940	98.190	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	13.12.2016	13.06.2018	32 220 100	CHF	1330.870	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Bayer N	EUR	1'000.00	13.12.2016	13.06.2018	32 220 101	CHF	1363.130	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SGS N	CHF	1'000.00	13.12.2016	13.06.2018	32 220 102	CHF	1226.940	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Adecco Group N	CHF	1'000.00	13.12.2016	13.06.2018	32 220 103	CHF	1164.900	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	13.03.2017	13.06.2018	34 906 877	CHF	1009.550	98.240	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	14.12.2016	14.06.2018	32 220 118	CHF	1085.150	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	15.12.2016	15.06.2018	32 220 123	CHF	1096.700	98.200	100.000		0.000	Y
8.5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.03.2017	15.06.2018	34 468 574	%	96.890	100.000	100.000	15.06. 15.09. 15.12.	0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	16.06.2015	18.06.2018	24 874 845	CHF	1148.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nikkei 225	USD	1'000.00	16.06.2015	18.06.2018	25 233 002	CHF	1092.630	96.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 18.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.481% 18.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	GBP	1'000.00	17.06.2015	18.06.2018	25 233 014		-	96.260	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	18.06.2015	18.06.2018	28 012 816	CHF	1002.730	96.090	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	18.06.2015	18.06.2018	28 012 810	%	124.300	96.310	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	18.06.2015	18.06.2018	28 012 809	%	104.000	96.310	100.000		0.000	Y
7.3 % Reverse Convertible on Indices 16.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	16.12.2015	18.06.2018	24 875 057		-	100.000	100.000	16.06.	0.000	N
3.9 % Reverse Convertible on Indices 19.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	17.06.2016	18.06.2018	31 883 820		-	100.000	100.000	19.06.	0.000	N
5.75 % Reverse Convertible on Indices 19.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	17.06.2016	18.06.2018	31 883 822		-	100.000	100.000	19.06.	4.333	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	17.06.2016	18.06.2018	32 219 311	CHF	1381.440	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	16.12.2016	18.06.2018	32 220 125	CHF	1411.060	100.000	100.000		0.000	Y
4.1 % Barrier Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	19.06.2014	19.06.2018	23 996 210	%	100.000	100.000	100.000	20.03. 19.06. 19.09. 19.12.	3.388 3.311 3.273 3.357	N
3.2 % Barrier Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	19.06.2014	19.06.2018	23 996 211	%	100.800	100.000	100.000	20.03. 19.06. 19.09. 19.12.	1.768 1.794 1.902 1.924	N
Reverse Convertible on Indices 19.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.202%	USD	1'000.00	19.06.2015	19.06.2018	28 012 818		-	96.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on IBEX 35	USD	1'000.00	19.06.2015	19.06.2018	25 233 024	%	97.300	96.060	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SGS N	CHF	1'000.00	19.12.2016	19.06.2018	32 220 132	CHF	1225.160	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.12.2016	19.06.2018	32 220 140	CHF	1369.130	98.180	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	20.12.2016	20.06.2018	32 220 152	CHF	1352.090	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	20.12.2016	20.06.2018	32 220 149	CHF	1352.830	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 20.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.986%	USD	1'000.00	20.03.2017	20.06.2018	34 906 994		-	98.190	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	21.12.2016	21.06.2018	34 906 033	CHF	1309.020	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	CHF	1'000.00	22.06.2016	22.06.2018	32 219 329	CHF	1205.150	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 23.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	23.06.2015	25.06.2018	25 233 046		-	96.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 26.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.245%	USD	1'000.00	24.06.2015	25.06.2018	25 233 059		-	96.140	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible 2015-9.6.17 on Index-Basket 26.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.824%	EUR	1'000.00	24.06.2015	25.06.2018	25 233 060		-	99.250	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	23.12.2016	25.06.2018	34 906 042	CHF	1367.190	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.12.2016	25.06.2018	34 906 049	%	104.710	98.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.12.2016	25.06.2018	34 906 050	%	98.160	98.010	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities 27.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	23.12.2016	25.06.2018	34 468 423		-	100.000	100.000	23.03. 23.06. 25.09. 27.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	27.06.2016	27.06.2018	32 219 348	CHF	1373.650	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	27.06.2016	27.06.2018	32 219 347	CHF	1164.150	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	27.12.2016	27.06.2018	34 906 055	CHF	1066.790	98.020	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roy.Philips	EUR	1'000.00	28.12.2016	28.06.2018	34 906 066	CHF	1319.400	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SAP	EUR	1'000.00	28.12.2016	28.06.2018	34 906 061	CHF	1326.700	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Total	EUR	1'000.00	28.12.2016	28.06.2018	34 906 064	CHF	1265.900	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.12.2016	28.06.2018	34 906 053	CHF	1087.040	98.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.12.2016	28.06.2018	34 906 059	%	99.500	98.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.12.2016	28.06.2018	34 906 060	%	102.610	98.010	100.000		0.000	N
Underlying Tracker on Iberdrola	EUR	1'000.00	28.12.2016	28.06.2018	34 906 063	CHF	1279.210	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Siemens N	EUR	1'000.00	28.12.2016	28.06.2018	34 906 062	CHF	1248.380	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Schneider Electric	EUR	1'000.00	28.12.2016	28.06.2018	34 906 065	CHF	1302.160	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	29.06.2015	29.06.2018	28 012 825	CHF	1229.820	99.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 29.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.979%	USD	1'000.00	29.06.2015	29.06.2018	25 233 064		-	96.310	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	29.06.2015	29.06.2018	28 012 824	CHF	1248.300	96.310	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible Called for red. on 29.06.17 at 100 % 29.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	29.12.2016	29.06.2018	34 468 428		-	100.000	100.000	29.06.	0.000	N
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.03.2017	29.06.2018	35 765 725	%	99.510	100.000	100.000	30.06. 29.09. 29.12.	0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	31.03.2017	29.06.2018	36 044 153	CHF	1208.090	100.000	100.000		0.000	Y
3.1 % Reverse Convertible on Indices 3.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	01.07.2016	02.07.2018	31 883 838		-	100.000	100.000	03.07.	0.000	N
8.25 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.07.2017	03.07.2018	36 851 981	%	97.660	100.000	100.000	03.10.	3.457	N
7.25 % Reverse Convertible Called for Red. on 05.01.18 at 100%	CHF	1'000.00	05.07.2017	05.07.2018	36 851 986	%	99.000	100.000	100.000	05.10.	0.000	N
Reverse Convertible on Indices 6.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.683%	USD	1'000.00	06.01.2016	06.07.2018	30 485 080		-	96.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	06.07.2016	06.07.2018	32 219 391	CHF	1579.490	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	06.07.2016	06.07.2018	32 646 821	CHF	1498.960	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 10.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.961%	USD	1'000.00	08.07.2015	09.07.2018	25 233 140		-	96.330	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	GBP	1'000.00	09.07.2015	09.07.2018	28 012 832	CHF	1450.080	96.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	07.07.2016	09.07.2018	32 219 399	CHF	1478.370	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities 9.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.07.2016	09.07.2018	31 883 858		-	100.000	100.000	09.01. 07.04. 07.07. 09.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	07.04.2017	09.07.2018	36 044 270	CHF	1225.100	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	10.07.2015	10.07.2018	28 012 844	CHF	1041.710	96.340	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	10.01.2017	10.07.2018	34 906 091	CHF	1297.820	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Unilever Cert	EUR	1'000.00	10.01.2017	10.07.2018	34 906 092	CHF	1418.580	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Heineken	EUR	1'000.00	10.01.2017	10.07.2018	34 906 093	CHF	1429.290	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 11.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.869%	USD	1'000.00	11.07.2016	11.07.2018	32 219 367		-	98.570	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	11.07.2016	11.07.2018	32 219 414	CHF	1547.610	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	11.07.2016	11.07.2018	32 219 413	CHF	1537.730	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	11.01.2017	11.07.2018	34 906 103	CHF	1077.170	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.01.2017	11.07.2018	34 906 108	CHF	1013.050	98.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	1'000.00	11.01.2017	11.07.2018	34 906 109	CHF	1128.560	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Zurich Insur Gr N	CHF	1'000.00	11.04.2017	11.07.2018	36 044 300	CHF	1085.940	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	12.07.2016	12.07.2018	32 219 415	CHF	1575.650	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	12.07.2016	12.07.2018	32 219 416	CHF	1579.660	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on AB InBev	EUR	1'000.00	12.01.2017	12.07.2018	34 906 110	CHF	1110.880	100.000	100.000		0.000	Y
6.25 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	12.04.2017	12.07.2018	35 765 749	%	98.980	100.000	100.000	12.07. 12.10.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	13.07.2015	13.07.2018	28 012 846	CHF	1048.530	96.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 13.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.25% 13.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	13.07.2015	13.07.2018	25 233 171		-	96.480	100.000	13.04.	0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 13.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.21%	USD	1'000.00	13.07.2015	13.07.2018	25 233 126		-	96.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 13.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.25% 13.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	13.07.2015	13.07.2018	25 233 170		-	96.480	100.000	13.04.	0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	13.01.2017	13.07.2018	34 906 127	CHF	1325.830	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	13.01.2017	13.07.2018	34 906 126	CHF	1325.600	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur Grp N	CHF	1'000.00	13.01.2017	13.07.2018	34 906 124	CHF	1062.390	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Total	EUR	1'000.00	13.01.2017	13.07.2018	34 906 128	CHF	1239.690	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 14.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.756%	USD	1'000.00	14.07.2015	16.07.2018	25 233 176		-	96.540	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 17.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.082%	USD	1'000.00	14.07.2015	16.07.2018	25 233 177		-	96.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	14.07.2016	16.07.2018	32 219 422	CHF	1341.030	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	14.07.2016	16.07.2018	32 219 421	CHF	1619.740	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	15.07.2016	16.07.2018	31 883 881	CHF	1595.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	16.01.2017	16.07.2018	34 906 131	CHF	1244.260	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur Grp N	CHF	1'000.00	16.01.2017	16.07.2018	34 906 134	CHF	1061.860	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ING Group	EUR	1'000.00	16.01.2017	16.07.2018	34 906 136	CHF	1305.310	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Clariant N	CHF	17.20	20.04.2017	16.07.2018	35 765 785	CHF	19.000	100.000	100.000		0.000	Y
3.1 % Barrier Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	17.07.2014	17.07.2018	23 071 727	%	100.870	100.000	100.000	17.01. 17.04. 17.07. 17.10.	1.340 1.335 1.380 1.439	N
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	17.07.2015	17.07.2018	25 233 200	CHF	1296.050	96.340	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	17.01.2017	17.07.2018	34 906 150	CHF	1078.330	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.01.2017	17.07.2018	34 906 166	%	102.430	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	17.01.2017	17.07.2018	34 906 155	CHF	1332.760	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Deutsche Telekom N	EUR	1'000.00	17.01.2017	17.07.2018	34 906 159	CHF	1165.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Vodafone Group	EUR	1'000.00	17.01.2017	17.07.2018	34 906 148	CHF	1306.780	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.01.2017	17.07.2018	34 906 139	CHF	830.340	98.020	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Deutsche Telekom N	EUR	1'000.00	17.01.2017	17.07.2018	34 906 151	CHF	1145.240	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	18.07.2016	18.07.2018	32 219 430	CHF	1579.460	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Deutsche Telekom N	EUR	1'000.00	18.01.2017	18.07.2018	34 906 173	CHF	1137.030	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur Grp N	CHF	1'000.00	18.01.2017	18.07.2018	34 906 172	CHF	1076.940	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	18.01.2017	18.07.2018	34 906 158	CHF	1334.200	98.020	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities 19.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.07.2016	19.07.2018	31 883 882		-	100.000	100.000	19.01. 19.04. 19.07. 19.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.01.2017	19.07.2018	34 906 183	CHF	1158.720	98.020	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	19.01.2017	19.07.2018	34 906 199	CHF	1318.030	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 20.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.93%	USD	1'000.00	20.07.2015	20.07.2018	25 233 205		-	96.240	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	20.07.2015	20.07.2018	25 233 204	CHF	971.800	96.230	100.000		0.000	Y
5.6 % Reverse Convertible on Indices 20.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	20.07.2016	20.07.2018	31 883 878		-	100.000	100.000	20.01. 20.07.	4.171 3.948	N
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	20.01.2017	20.07.2018	34 906 220	CHF	1298.160	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	21.07.2015	23.07.2018	25 233 217	%	101.000	96.370	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	21.07.2016	23.07.2018	32 219 436	CHF	1486.950	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	23.01.2017	23.07.2018	34 906 223	CHF	1444.860	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.01.2017	24.07.2018	34 906 247	CHF	1315.850	98.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	24.01.2017	24.07.2018	34 906 230	CHF	1343.480	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.01.2017	24.07.2018	34 906 246	CHF	1070.480	98.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur Grp N	CHF	1'000.00	25.01.2017	25.07.2018	34 906 254	CHF	1091.030	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	25.01.2017	25.07.2018	34 906 264	CHF	1271.340	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	25.01.2017	25.07.2018	34 906 261	CHF	1249.170	98.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Allianz N	EUR	1'000.00	25.01.2017	25.07.2018	34 906 255	CHF	1387.710	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 26.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.708%	USD	1'000.00	26.01.2017	26.07.2018	34 906 272		-	97.940	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	26.01.2017	26.07.2018	34 906 271	CHF	1312.770	97.990	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	26.01.2017	26.07.2018	34 906 267	CHF	1338.900	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	26.01.2017	26.07.2018	34 906 266	CHF	1090.880	98.020	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	27.07.2015	27.07.2018	25 233 232	CHF	1251.900	99.450	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Telefonica Br	EUR	1'000.00	27.01.2017	27.07.2018	34 906 277	CHF	1139.380	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	27.01.2017	27.07.2018	34 906 284	CHF	1103.980	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	27.01.2017	27.07.2018	34 906 286	CHF	1103.350	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	27.01.2017	27.07.2018	34 906 285	CHF	1103.980	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	27.04.2017	27.07.2018	36 453 857	CHF	1212.420	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	27.04.2017	27.07.2018	36 453 858	CHF	1212.420	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	29.07.2016	30.07.2018	32 219 454	CHF	1145.780	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.175%	USD	1'000.00	29.07.2016	30.07.2018	32 219 459		-	98.100	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	29.07.2016	30.07.2018	32 219 456	CHF	1143.060	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Caterpillar Rg	USD	1'000.00	30.01.2017	30.07.2018	34 906 303	CHF	1610.360	97.990	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Commodities	USD	1'000.00	30.01.2017	30.07.2018	34 906 302	CHF	1143.050	98.010	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	30.01.2017	30.07.2018	34 906 290	CHF	1337.220	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	30.01.2017	30.07.2018	34 906 293	CHF	1084.300	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Adecco Group N	CHF	1'000.00	30.01.2017	30.07.2018	34 906 292	CHF	1051.290	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	31.07.2015	31.07.2018	28 883 850	%	100.500	96.340	100.000		0.000	Y
(no min.) Structured Note Credit Linked on Dufry AG	CHF	1'000.00	31.07.2015	31.07.2018	28 012 794	%	99.460	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	3.653 3.760 3.755 3.725	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	31.07.2015	31.07.2018	24 874 896	CHF	1091.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	01.02.2017	01.08.2018	34 906 344	CHF	1166.240	97.960	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nikkei 225	EUR	1'000.00	01.02.2017	01.08.2018	34 906 320	%	108.400	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	01.02.2017	01.08.2018	34 906 345	CHF	1312.830	97.960	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	01.02.2017	01.08.2018	34 906 349	CHF	1089.580	97.960	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	01.02.2017	02.08.2018	34 906 322	CHF	1156.770	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	02.02.2017	02.08.2018	34 906 359	CHF	1054.950	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.02.2017	02.08.2018	34 906 364	CHF	1182.230	97.960	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	02.02.2017	02.08.2018	34 906 354	CHF	1047.140	97.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	03.08.2015	03.08.2018	28 883 860	%	100.200	96.250	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible on Indices 3.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	03.08.2015	03.08.2018	24 874 915		-	100.000	100.000	03.05.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	03.02.2017	03.08.2018	34 906 387	CHF	1191.600	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	03.02.2017	03.08.2018	34 906 374	CHF	1184.100	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	03.02.2017	03.08.2018	34 906 381	CHF	1194.420	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	03.02.2017	03.08.2018	34 906 379	CHF	1195.890	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	03.02.2017	03.08.2018	34 906 378	CHF	1199.940	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	03.02.2017	03.08.2018	34 906 376	CHF	1195.170	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	03.02.2017	03.08.2018	34 906 391	CHF	1198.740	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	03.02.2017	03.08.2018	34 906 373	CHF	1185.890	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	03.02.2017	03.08.2018	34 906 383	CHF	1191.570	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	04.08.2015	06.08.2018	28 883 866	%	100.500	96.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	04.08.2015	06.08.2018	28 883 867	CHF	1285.920	99.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.02.2017	06.08.2018	34 906 395	CHF	1199.270	97.970	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.02.2017	06.08.2018	34 906 401	CHF	1104.380	97.970	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.02.2017	07.08.2018	34 906 417	CHF	1107.080	97.990	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	08.08.2016	08.08.2018	32 219 475	CHF	1057.970	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	08.02.2017	08.08.2018	34 906 444	CHF	1048.590	97.990	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	08.02.2017	08.08.2018	34 906 429	CHF	1098.890	97.990	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	08.02.2017	08.08.2018	34 906 428	CHF	1098.780	97.990	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Novartis N	CHF	68.50	10.04.2017	08.08.2018	35 765 769	CHF	72.850	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Novartis N	CHF	67.30	10.04.2017	08.08.2018	35 765 768	CHF	70.950	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Adecco Group N	CHF	1'000.00	09.08.2016	09.08.2018	32 219 478	CHF	1408.160	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur Grp N	CHF	1'000.00	10.02.2017	10.08.2018	34 906 474	CHF	1093.820	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Daimler N	EUR	1'000.00	10.02.2017	10.08.2018	34 906 475	CHF	1278.200	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Funds	USD	1'000.00	10.02.2017	10.08.2018	34 906 481	CHF	1112.090	97.980	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	USD	1'000.00	10.02.2017	10.08.2018	34 906 478	CHF	1072.280	97.980	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	10.02.2017	10.08.2018	34 906 477	CHF	1052.640	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 12.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.156%	GBP	1'000.00	12.02.2015	13.08.2018	25 232 358		-	96.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 12.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.854%	EUR	1'000.00	12.02.2015	13.08.2018	25 232 357		-	99.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	12.08.2015	13.08.2018	28 883 889	%	101.480	96.390	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	13.08.2015	13.08.2018	25 233 223	CHF	1151.420	99.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	13.08.2015	13.08.2018	28 883 905	%	101.240	96.240	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Commerzbank	EUR	1'000.00	11.08.2016	13.08.2018	32 219 491	CHF	2782.170	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Bank of America	USD	1'000.00	11.08.2016	13.08.2018	32 219 490	CHF	1993.360	98.140	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	12.08.2016	13.08.2018	32 219 493	CHF	1144.420	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Adecco Group N	CHF	1'000.00	12.08.2016	13.08.2018	32 219 494	CHF	1385.640	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Indices 14.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	12.08.2016	13.08.2018	31 883 914		-	100.000	100.000	13.02. 14.08.	4.924 4.753	N
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	14.02.2017	14.08.2018	34 906 507	CHF	1123.550	98.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.02.2017	14.08.2018	34 906 520	%	93.800	97.980	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	14.02.2017	14.08.2018	34 906 514	CHF	1324.760	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	15.08.2016	15.08.2018	32 219 499	CHF	1436.410	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on NASDAQ 100	USD	1'000.00	15.08.2016	15.08.2018	32 219 503	CHF	1304.690	98.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	15.08.2016	15.08.2018	32 219 502	CHF	1193.520	98.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on AXA P	USD	1'000.00	15.02.2017	15.08.2018	34 906 532	CHF	1185.320	97.990	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CS Group N	USD	1'000.00	15.02.2017	15.08.2018	34 906 531	CHF	1300.930	97.990	100.000		0.000	Y
ProNote on FTSE 100-Index	GBP	1'000.00	16.08.2013	16.08.2018	21 930 885	%	108.000	92.640	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	16.08.2016	16.08.2018	32 219 513	CHF	1462.820	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	USD	1'000.00	16.08.2016	16.08.2018	32 219 505	CHF	1096.780	98.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	16.08.2016	16.08.2018	32 219 509	CHF	1466.640	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 16.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.127%	USD	1'000.00	16.08.2016	16.08.2018	32 219 522		-	98.070	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on NASDAQ 100	USD	1'000.00	16.08.2016	16.08.2018	32 219 515	CHF	1297.000	98.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	16.08.2016	16.08.2018	32 219 506	CHF	1120.630	98.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	16.08.2016	16.08.2018	32 219 510	CHF	1623.730	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur Gr N	CHF	1'000.00	16.02.2017	16.08.2018	34 906 545	CHF	1141.800	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	16.02.2017	16.08.2018	34 906 544	CHF	1125.300	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	17.08.2016	17.08.2018	32 219 526	CHF	1145.160	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on E.ON N	EUR	1'000.00	17.08.2016	17.08.2018	32 219 528	CHF	1554.480	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	17.08.2016	17.08.2018	32 219 527	CHF	1226.870	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	17.02.2017	17.08.2018	34 906 555	CHF	1043.660	97.970	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	17.02.2017	17.08.2018	34 906 570	CHF	1318.560	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on The Swatch Grp I	CHF	1'000.00	17.02.2017	17.08.2018	34 906 560	CHF	1175.500	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on UBS Group N	CHF	1'000.00	17.02.2017	17.08.2018	34 906 561	CHF	1133.060	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on BASF N	EUR	1'000.00	17.02.2017	17.08.2018	34 906 568	CHF	1233.200	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	17.02.2017	17.08.2018	34 906 566	CHF	1031.220	100.000	100.000		0.000	Y
9.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.05.2017	17.08.2018	35 765 815	%	98.280	100.000	100.000	17.08. 17.11.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Nikkei 225	USD	1'000.00	18.08.2015	20.08.2018	28 883 922	CHF	1069.720	96.210	100.000		0.000	Y
9.5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.05.2017	20.08.2018	35 765 819	%	95.630	100.000	100.000	18.08. 20.11.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.05.2017	20.08.2018	36 454 093	CHF	1187.290	98.250	100.000		0.000	Y
8.25 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.05.2017	20.08.2018	35 765 822	%	99.090	100.000	100.000	19.08. 19.11.	3.385 3.493	N
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.05.2017	20.08.2018	36 454 087	CHF	1000.620	98.240	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Caterpillar	USD	1'000.00	21.08.2015	21.08.2018	28 883 960	CHF	1913.860	96.310	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	21.02.2017	21.08.2018	34 906 585	CHF	1356.180	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	21.02.2017	21.08.2018	34 906 584	CHF	1156.950	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	21.02.2017	21.08.2018	34 906 587	CHF	1157.290	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
10.75 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.08.2017	21.08.2018	36 852 076	%	99.840	100.000	100.000	21.11.	3.646	N
Underlying Tracker on ING Group Rg	EUR	1'000.00	22.02.2017	22.08.2018	34 906 619	CHF	1309.870	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	23.08.2016	23.08.2018	32 219 537	CHF	1436.020	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Adecco Group N	CHF	1'000.00	23.08.2016	23.08.2018	32 219 541	CHF	1318.580	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	23.11.2017	23.08.2018	38 487 077	CHF	1180.350	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	24.08.2016	24.08.2018	32 219 550	CHF	1197.370	98.040	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	24.08.2016	24.08.2018	32 219 549	CHF	1489.280	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	24.02.2017	24.08.2018	34 906 643	CHF	1109.090	97.880	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on OC Oerlikon N	CHF	1'000.00	24.02.2017	24.08.2018	34 906 649	CHF	1425.570	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 25.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.922%	EUR	1'000.00	25.08.2015	27.08.2018	28 883 932		-	99.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 26.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.259% 26.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	26.08.2015	27.08.2018	28 883 979		-	96.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 30.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.303%	USD	1'000.00	27.08.2015	27.08.2018	28 883 987		-	96.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 27.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.025%	USD	1'000.00	27.08.2015	27.08.2018	28 883 986		-	96.570	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	25.08.2016	27.08.2018	32 219 558	CHF	1060.030	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	26.08.2016	27.08.2018	33 162 666	CHF	1191.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	27.02.2017	27.08.2018	34 906 661	CHF	1097.280	97.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	27.02.2017	27.08.2018	34 906 647	CHF	1108.520	97.880	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on AXA P	EUR	1'000.00	27.02.2017	27.08.2018	34 906 663	CHF	1312.520	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	27.02.2017	27.08.2018	34 906 666	CHF	1030.830	97.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur Gr N	CHF	1'000.00	27.02.2017	27.08.2018	34 906 662	CHF	1067.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	27.02.2017	27.08.2018	34 906 660	CHF	1219.900	97.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Sonova Hldg N	CHF	142.65	30.05.2017	27.08.2018	35 765 866	CHF	141.500	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	25.08.2015	28.08.2018	28 845 413	%	102.400	96.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket of Indices	CHF	1'000.00	28.08.2015	28.08.2018	28 883 993	%	100.900	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	28.02.2017	28.08.2018	34 468 533	CHF	1274.290	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 28.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.652%	USD	1'000.00	28.02.2017	28.08.2018	34 906 680		-	97.850	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.02.2017	28.08.2018	34 906 677	CHF	1167.220	97.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.02.2017	28.08.2018	34 906 682	CHF	1033.490	97.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.02.2017	28.08.2018	34 906 684	CHF	1034.080	97.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	30.08.2016	30.08.2018	32 219 567	CHF	1091.550	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	30.08.2016	30.08.2018	32 219 568	CHF	1190.570	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Las Vegas Sands	USD	1'000.00	31.08.2016	31.08.2018	32 219 573	CHF	1292.060	98.050	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	31.08.2016	31.08.2018	32 219 576	CHF	1102.930	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	CHF	1'000.00	01.09.2016	03.09.2018	32 646 852	CHF	1164.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	01.09.2016	03.09.2018	32 219 579	CHF	1093.600	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	02.09.2016	03.09.2018	32 219 582	CHF	1156.600	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	01.03.2017	03.09.2018	34 468 534	CHF	1085.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	03.03.2017	03.09.2018	34 906 745	CHF	1321.780	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	03.03.2017	03.09.2018	34 906 764	CHF	1252.730	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CS Group N	CHF	1'000.00	03.03.2017	03.09.2018	34 468 544	CHF	1237.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	03.03.2017	03.09.2018	34 906 742	CHF	1328.020	100.000	100.000		0.000	Y
7.25 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	01.09.2017	03.09.2018	36 852 105	%	99.920	100.000	100.000	01.12.	0.000	N
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	01.03.2017	04.09.2018	34 906 704	CHF	1029.250	97.880	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Starbucks Rg	USD	1'000.00	02.03.2017	04.09.2018	34 906 728	CHF	972.620	97.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.03.2017	04.09.2018	34 906 761	CHF	1329.790	97.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Exxon Mobil Rg	USD	1'000.00	03.03.2017	04.09.2018	34 906 756	CHF	1015.390	97.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Apple Rg	USD	1'000.00	03.03.2017	04.09.2018	34 906 758	CHF	1208.840	97.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	03.03.2017	04.09.2018	34 906 759	CHF	1042.480	97.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	03.03.2017	04.09.2018	34 906 767	CHF	1047.970	97.930	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Axa	EUR	1'000.00	05.09.2016	05.09.2018	32 219 589	CHF	1594.370	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	05.09.2016	05.09.2018	32 219 584	CHF	1153.350	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	05.09.2016	05.09.2018	32 219 587	CHF	1479.490	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Daimler N	EUR	1'000.00	05.09.2016	05.09.2018	32 219 588	CHF	1409.870	100.000	100.000		0.000	Y
Capped Pro-Notes on Equities	CHF	1'000.00	06.09.2013	06.09.2018	21 496 875	%	105.190	96.190	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	06.09.2016	06.09.2018	32 219 593	CHF	1549.030	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	06.09.2016	06.09.2018	32 219 592	CHF	1364.590	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	06.09.2016	06.09.2018	32 219 594	CHF	1130.160	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	06.03.2017	06.09.2018	34 906 783	CHF	1085.630	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	06.03.2017	06.09.2018	34 906 790	CHF	1228.620	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on AB InBev Rg	EUR	1'000.00	06.03.2017	06.09.2018	34 906 776	CHF	1076.980	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ING Group Rg	EUR	1'000.00	07.03.2017	07.09.2018	34 906 796	CHF	1381.780	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	07.03.2017	07.09.2018	34 906 791	CHF	1122.240	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur Gr N	CHF	1'000.00	07.03.2017	07.09.2018	34 906 797	CHF	1093.320	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	09.09.2015	10.09.2018	28 884 067	CHF	1404.340	99.450	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	08.09.2016	10.09.2018	33 162 689		-	100.000	100.000	08.03. 08.06. 08.09.	2.612 2.490 2.440	N
8.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.09.2016	10.09.2018	32 219 611	%	45.930	97.970	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	USD	1'000.00	08.03.2017	10.09.2018	34 906 823	CHF	1035.350	97.900	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	USD	1'000.00	08.03.2017	10.09.2018	34 906 822	CHF	1036.530	97.900	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ING Group Rg	EUR	1'000.00	08.03.2017	10.09.2018	34 906 826	CHF	1334.020	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on HSBC Hldg Rg	USD	1'000.00	09.03.2017	10.09.2018	34 906 854	CHF	1054.460	97.790	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Societe Generale	EUR	1'000.00	09.03.2017	10.09.2018	34 906 853	CHF	1183.920	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	10.03.2017	10.09.2018	34 906 859	CHF	997.380	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	12.09.2016	12.09.2018	32 219 620	CHF	1508.830	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on General Electric	USD	1'000.00	12.09.2016	12.09.2018	32 219 617	CHF	534.480	97.940	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	12.09.2016	12.09.2018	32 219 614	CHF	1271.030	97.960	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	12.09.2016	12.09.2018	32 219 621	CHF	1087.090	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	13.09.2016	13.09.2018	32 219 629	CHF	1193.340	98.040	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	13.03.2017	13.09.2018	34 906 873	CHF	1012.410	97.770	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.03.2017	13.09.2018	34 906 886	CHF	1134.470	97.770	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.03.2017	13.09.2018	34 906 887	CHF	1135.410	97.790	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	13.03.2017	13.09.2018	34 906 872	CHF	1026.180	97.770	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Deutsche Telekom N	EUR	1'000.00	13.03.2017	13.09.2018	34 906 875	CHF	1137.030	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	14.09.2016	14.09.2018	32 646 860		-	98.050	100.000		0.000	Y
14.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.081%												
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	14.03.2017	14.09.2018	34 906 898	CHF	1027.060	97.790	100.000		0.000	Y
8.5 % Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	15.09.2016	17.09.2018	33 162 686		-	100.000	100.000	15.03. 15.09.	5.191 4.712	N
15.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	16.09.2016	17.09.2018	32 219 646	CHF	1467.420	98.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	16.09.2016	17.09.2018	32 219 647	CHF	1203.730	98.030	100.000		0.000	Y
5.25 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.09.2016	17.09.2018	33 162 713		-	100.000	100.000	16.03. 18.09.	0.000 0.000	N
18.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Underlying Tracker on UBS Group N	CHF	1'000.00	15.03.2017	17.09.2018	34 906 918	CHF	1116.820	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	15.03.2017	17.09.2018	34 906 924	CHF	1025.190	97.790	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nokia Rg	EUR	1'000.00	17.03.2017	17.09.2018	34 906 962	CHF	914.690	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Intesa Sanpaolo N	CHF	1'000.00	17.03.2017	17.09.2018	34 906 963	CHF	1112.750	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	17.03.2017	17.09.2018	34 906 964	CHF	1011.860	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nokia Rg	EUR	1'000.00	17.03.2017	17.09.2018	34 906 965	CHF	912.790	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on JPMorgan Chase Rg	USD	1'000.00	17.03.2017	17.09.2018	34 906 974	CHF	1131.950	97.730	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Apple Rg	USD	1'000.00	17.03.2017	17.09.2018	34 906 972	CHF	1180.700	97.730	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on General Electric Rg	USD	1'000.00	17.03.2017	17.09.2018	34 906 975	CHF	561.450	97.730	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Credit Agricole	EUR	1'000.00	17.03.2017	17.09.2018	34 906 958	CHF	1296.280	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Tesla Rg	USD	1'000.00	17.03.2017	17.09.2018	34 906 981	CHF	1259.660	97.730	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	17.03.2017	17.09.2018	34 468 579	CHF	1027.090	97.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Wal-Mart Stores Rg	USD	1'000.00	17.03.2017	17.09.2018	34 906 982	CHF	1358.020	97.730	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Medtronic Rg	USD	1'000.00	17.03.2017	17.09.2018	34 906 979	CHF	968.220	97.730	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Pfizer Rg	USD	1'000.00	17.03.2017	17.09.2018	34 906 980	CHF	1030.610	97.730	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Intel Rg	USD	1'000.00	17.03.2017	17.09.2018	34 906 978	CHF	1226.050	97.730	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Gilead Sciences Rg	USD	1'000.00	17.03.2017	17.09.2018	34 906 976	CHF	1046.810	97.730	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible Called for red. on 18.12.17 at 100%	USD	1'000.00	16.06.2017	17.09.2018	35 765 886		-	100.000	100.000	18.09. 18.12.	3.456 3.547	N
18.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Protection Participation on S&P 500	USD	1'000.00	15.09.2017	17.09.2018	37 357 508	%	95.070	93.660	95.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
3.4 % Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	18.09.2014	18.09.2018	23 071 812	%	101.480	100.000	100.000	18.03. 19.06. 18.09. 18.12.	0.96457 0.97888 1.033 1.047	N
3.1 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	18.09.2014	18.09.2018	23 071 813	%	101.360	100.000	100.000	18.03. 19.06. 18.09. 18.12.	0.325 0.325 0.325 0.325	N
3.6 % Reverse Convertible on Indices 20.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.09.2014	19.09.2018	24 439 477		-	100.000	100.000	19.03.	0.350	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	19.09.2016	19.09.2018	32 219 653	CHF	1108.170	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	20.09.2016	20.09.2018	32 219 658	CHF	1375.850	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	20.09.2016	20.09.2018	32 219 657	CHF	1136.560	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	20.03.2017	20.09.2018	34 906 989	CHF	1343.670	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	20.06.2017	20.09.2018	36 454 349	CHF	1284.820	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	21.09.2016	21.09.2018	32 219 670	CHF	1370.360	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	21.09.2016	21.09.2018	32 219 665	CHF	1462.640	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	21.09.2016	21.09.2018	33 162 722	CHF	1295.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	21.09.2016	21.09.2018	32 219 663	CHF	1315.150	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	21.09.2016	21.09.2018	32 219 666	CHF	1221.850	97.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 21.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.022% 21.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	21.03.2017	21.09.2018	34 907 006		-	97.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 26.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.414%	USD	1'000.00	24.09.2015	24.09.2018	28 884 112		-	96.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Telefonica 22.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	22.09.2016	24.09.2018	32 219 674		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CS Group N	USD	1'000.00	22.09.2016	24.09.2018	32 219 679	CHF	1304.450	98.020	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Daimler N	EUR	1'000.00	22.09.2016	24.09.2018	32 219 675	CHF	1366.570	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	23.09.2016	24.09.2018	32 219 682	CHF	1214.930	98.020	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	22.03.2017	24.09.2018	36 044 008	CHF	1021.090	97.700	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	22.03.2017	24.09.2018	36 044 006	CHF	1017.100	97.700	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	22.03.2017	24.09.2018	36 043 990	CHF	1092.100	97.700	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	22.03.2017	24.09.2018	36 043 985	CHF	1024.360	97.710	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CS Group N	USD	1'000.00	22.03.2017	24.09.2018	36 043 982	CHF	1145.410	97.710	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on E.ON N	EUR	1'000.00	22.03.2017	24.09.2018	36 043 987	CHF	1534.350	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	23.03.2017	24.09.2018	36 044 013	CHF	1056.300	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	23.03.2017	24.09.2018	36 044 015	CHF	1090.460	97.700	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ING Group Rg	USD	1'000.00	23.03.2017	24.09.2018	36 044 016	CHF	1054.820	97.700	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	23.03.2017	24.09.2018	36 044 018	CHF	1015.300	97.710	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nokia Rg	EUR	1'000.00	23.03.2017	24.09.2018	36 044 019	CHF	894.570	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.03.2017	24.09.2018	36 044 046	CHF	1205.580	97.770	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	24.03.2017	24.09.2018	36 044 037	CHF	1017.660	97.770	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Allianz N	EUR	1'000.00	24.03.2017	24.09.2018	36 044 024	CHF	1326.680	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	24.03.2017	24.09.2018	35 765 715	CHF	1015.400	97.730	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Barrick Gold Rg	USD	15.45	27.04.2017	25.09.2018	35 765 799	CHF	13.590	98.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	26.09.2016	26.09.2018	32 219 685	CHF	1117.630	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	27.09.2016	27.09.2018	32 219 691	CHF	1426.990	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	27.03.2017	27.09.2018	36 044 058	CHF	1014.780	97.770	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 29.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.142%	USD	1'000.00	29.09.2015	28.09.2018	28 884 123		-	96.760	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	28.09.2016	28.09.2018	32 219 709	CHF	1490.130	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	28.09.2016	28.09.2018	32 219 707	CHF	1369.120	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	30.09.2016	28.09.2018	32 219 727	CHF	1350.960	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	30.09.2016	28.09.2018	32 219 726	CHF	1197.540	97.980	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	30.09.2016	28.09.2018	33 162 740	CHF	1132.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Commerzbank	USD	1'000.00	30.09.2016	28.09.2018	32 219 730	CHF	1912.740	97.980	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	30.09.2016	28.09.2018	32 219 728	CHF	1048.100	97.980	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.03.2017	28.09.2018	36 044 079	CHF	682.030	97.770	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	28.03.2017	28.09.2018	36 044 074	CHF	1190.050	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	28.03.2017	28.09.2018	36 044 076	CHF	1078.440	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on STXE6O&G EUR P	USD	1'000.00	31.03.2017	28.09.2018	35 765 733	CHF	1025.140	97.830	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Swiss Re N	CHF	1'000.00	31.03.2017	28.09.2018	36 044 152	CHF	1054.740	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur Gr N	CHF	1'000.00	31.03.2017	28.09.2018	36 044 151	CHF	1061.520	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Deutsche Telekom N	EUR	1'000.00	31.03.2017	28.09.2018	36 044 154	CHF	1129.450	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	31.03.2017	28.09.2018	36 044 170	CHF	1004.170	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nokia Rg	EUR	1'000.00	31.03.2017	28.09.2018	36 044 155	CHF	916.570	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	31.03.2017	28.09.2018	36 044 159	CHF	1330.790	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nokia Rg	EUR	1'000.00	31.03.2017	28.09.2018	36 044 157	CHF	918.460	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Blackrock	USD	1'000.00	31.03.2017	28.09.2018	36 044 161	CHF	1317.670	97.800	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nokia Rg	EUR	1'000.00	31.03.2017	28.09.2018	36 044 156	CHF	917.510	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Indices	USD	1'000.00	30.03.2016	01.10.2018	31 562 248	%	105.700	97.490	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CS Group N	CHF	1'000.00	03.04.2017	03.10.2018	36 044 193	CHF	1309.970	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Blackrock	USD	1'000.00	03.04.2017	03.10.2018	36 044 200	CHF	1343.570	97.800	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	03.04.2017	03.10.2018	36 044 198	CHF	1113.870	97.800	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Generali N	EUR	1'000.00	03.04.2017	03.10.2018	36 044 197	CHF	1340.450	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on E.ON N	EUR	1'000.00	03.04.2017	03.10.2018	36 044 196	CHF	1463.020	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on UBS Group N	CHF	1'000.00	03.04.2017	03.10.2018	36 044 195	CHF	1230.820	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Daimler N	EUR	1'000.00	03.04.2017	03.10.2018	36 044 194	CHF	1254.480	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	04.07.2017	04.10.2018	36 454 466	CHF	1180.150	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	05.04.2017	05.10.2018	36 044 228	CHF	1254.610	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on The Swatch Grp I	CHF	1'000.00	05.04.2017	05.10.2018	36 044 227	CHF	1136.680	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	05.04.2017	05.10.2018	36 044 224	CHF	1108.860	100.000	100.000		0.000	Y
7.5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.04.2017	05.10.2018	35 765 736	%	99.370	100.000	100.000	05.10.	7.285	N
10 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.07.2017	05.10.2018	36 851 985	%	99.460	100.000	100.000	05.10.	3.593	N
Underlying Tracker on Generali N	EUR	1'000.00	06.04.2017	08.10.2018	36 044 240	CHF	1325.320	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on UBS Group N	CHF	1'000.00	06.04.2017	08.10.2018	36 044 241	CHF	1205.570	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CS Group N	CHF	1'000.00	06.04.2017	08.10.2018	36 044 239	CHF	1285.160	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on E.ON N	EUR	1'000.00	06.04.2017	08.10.2018	36 044 243	CHF	1449.650	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	07.04.2017	08.10.2018	36 044 264	CHF	1078.850	100.000	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.07.2017	08.10.2018	36 851 988	%	99.030	100.000	100.000	06.10.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.10.2016	09.10.2018	32 219 764	CHF	1403.930	98.020	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.10.2016	09.10.2018	32 219 766	CHF	1392.390	98.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	07.04.2017	09.10.2018	36 044 268	CHF	1005.780	97.810	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on iShs MSCI Em Mk	USD	1'000.00	07.04.2017	09.10.2018	36 044 273	CHF	1156.030	97.800	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CS Group N	USD	1'000.00	10.04.2017	10.10.2018	36 044 281	CHF	1186.520	97.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.07.2017	10.10.2018	36 454 505	%	87.870	98.170	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	11.10.2016	11.10.2018	32 219 769	CHF	1353.170	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	11.04.2017	11.10.2018	36 044 302	CHF	1066.440	100.000	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible on Indices 12.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	12.10.2015	12.10.2018	24 875 004		-	100.000	100.000	12.10.	0.000	N
Underlying Tracker on CS Group N	CHF	1'000.00	12.04.2017	12.10.2018	36 044 315	CHF	1261.420	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 14.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	14.10.2014	15.10.2018	24 439 554		-	93.590	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on The Kraft Heinz	USD	1.00	15.10.2015	15.10.2018	24 875 018	CHF	79.850	97.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 13.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.641%	GBP	1'000.00	13.10.2016	15.10.2018	34 112 867		-	99.010	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	14.10.2016	15.10.2018	32 219 790	CHF	1332.410	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Deutsche Telekom N	EUR	1'000.00	13.04.2017	15.10.2018	36 044 338	CHF	1137.590	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CS Group N	CHF	1'000.00	13.04.2017	15.10.2018	36 044 341	CHF	1301.200	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Deutsche Telekom N	EUR	1'000.00	13.04.2017	15.10.2018	36 044 339	CHF	1137.700	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	13.07.2017	15.10.2018	36 454 542	CHF	1050.230	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on TevaPharmInd Sp ADR	USD	1'000.00	17.10.2016	17.10.2018	32 219 797	CHF	405.420	97.870	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	17.04.2017	17.10.2018	36 044 362	CHF	1097.870	97.830	100.000		0.000	Y
ProNote on a Basket of Funds	USD	1'000'000.00	22.07.2014	18.10.2018	23 717 920	%	99.060	91.540	97.500		0.000	Y
Reverse Convertible on E.ON N	EUR	1'000.00	18.04.2017	18.10.2018	35 568 615	%	82.800	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CS Group N	CHF	1'000.00	18.04.2017	18.10.2018	36 044 360	CHF	1291.150	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	18.04.2017	18.10.2018	36 044 379	CHF	1006.700	97.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.613%	USD	1'000.00	19.04.2017	19.10.2018	36 044 323		-	97.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Swiss Re N	CHF	1'000.00	19.04.2017	19.10.2018	36 044 377	CHF	1043.480	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 20.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.843%	GBP	1'000.00	20.10.2014	22.10.2018	24 439 620		-	94.070	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	21.10.2016	22.10.2018	32 219 825	CHF	1360.900	100.000	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.04.2017	22.10.2018	35 765 767	%	97.250	100.000	100.000	20.07. 20.10.	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	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Deutsche Telekom N	EUR	1'000.00	21.04.2017	22.10.2018	36 044 425	CHF	1135.080	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Swiss Re N	CHF	1'000.00	21.04.2017	22.10.2018	36 044 424	CHF	1047.210	100.000	100.000		0.000	Y
3.1 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	23.10.2014	23.10.2018	23 071 854	%	101.730	100.000	100.000	23.01. 24.04. 24.07. 23.10.	0.300 0.300 0.300 0.29032	N
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 23.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.935%	EUR	1'000.00	23.10.2015	23.10.2018	28 884 172		-	99.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 23.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.506%	USD	1'000.00	23.10.2015	23.10.2018	28 884 174		-	97.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	24.10.2016	24.10.2018	32 219 831	CHF	1374.050	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	24.10.2016	24.10.2018	32 219 830	CHF	1345.420	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Indices	USD	1'000.00	24.04.2017	24.10.2018	35 568 617	%	95.300	94.930	97.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	24.04.2017	24.10.2018	36 044 435	CHF	1039.080	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	25.10.2016	25.10.2018	32 219 837	%	102.490	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	25.07.2017	25.10.2018	36 454 637	CHF	962.680	98.170	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities 26.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	26.04.2016	26.10.2018	31 883 735		-	100.000	100.000	26.01. 26.04. 26.07.	0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker on SMI	USD	1'000.00	26.04.2017	26.10.2018	36 044 471	CHF	1053.370	97.930	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	26.04.2017	26.10.2018	36 044 469	CHF	1023.370	97.930	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	26.04.2017	26.10.2018	36 044 463	CHF	1006.130	97.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	26.07.2017	26.10.2018	36 454 652	CHF	1169.480	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	26.07.2017	26.10.2018	36 454 666	CHF	591.760	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	26.07.2017	26.10.2018	36 454 657	CHF	1022.810	98.180	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 31.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.404%	USD	1'000.00	29.10.2015	29.10.2018	28 884 202		-	97.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Alibaba Grp Sp ADS 27.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.269%	USD	1'000.00	27.10.2016	29.10.2018	32 219 851		-	97.960	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	27.10.2016	29.10.2018	32 219 850	CHF	1280.020	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Gilead Sciences Rg	USD	1'000.00	27.04.2017	29.10.2018	36 453 865	CHF	1065.660	97.930	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	28.04.2017	29.10.2018	36 453 884	CHF	1097.950	97.880	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	CHF	1'000.00	28.04.2017	29.10.2018	36 453 880	CHF	1068.790	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	02.08.2017	02.11.2018	36 454 706	CHF	1081.210	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 7.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.37%	USD	1'000.00	05.11.2015	05.11.2018	28 884 210		-	97.070	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nokia	EUR	1'000.00	04.11.2016	05.11.2018	32 219 892	CHF	1124.920	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.05.2017	05.11.2018	36 453 914	CHF	951.180	97.800	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	03.05.2017	05.11.2018	36 453 915	CHF	1074.840	97.790	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	04.05.2017	05.11.2018	36 453 925	CHF	1154.340	97.800	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	05.05.2017	05.11.2018	36 453 926	CHF	1114.010	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	05.05.2017	05.11.2018	36 453 924	CHF	1218.500	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Boeing Co Rg	USD	1'000.00	04.08.2017	05.11.2018	36 454 744	CHF	1188.280	98.140	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.11.2017	05.11.2018	38 064 860	%	98.550	100.000	100.000		0.000	N
4.7 % Reverse Convertible on Indices 7.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.11.2015	06.11.2018	28 884 214		-	100.000	100.000	06.02. 08.05. 07.08.	0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	07.08.2017	07.11.2018	36 454 750	CHF	1138.400	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	09.05.2017	09.11.2018	36 453 949	CHF	1036.710	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P 10.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.409%	USD	1'000.00	10.11.2015	13.11.2018	30 112 500		-	96.660	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	12.11.2015	13.11.2018	30 112 504	CHF	666.540	96.570	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.05.2017	13.11.2018	36 453 987	CHF	1268.250	97.840	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Tesla Rg	USD	1'000.00	12.05.2017	13.11.2018	36 454 002	CHF	1050.660	97.800	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Tesla Rg	USD	1'000.00	12.05.2017	13.11.2018	36 454 011	CHF	1045.840	97.800	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Tesla Rg	USD	1'000.00	12.05.2017	13.11.2018	36 454 013	CHF	1038.700	97.800	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	14.11.2016	14.11.2018	32 219 917	CHF	1366.580	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	14.11.2016	14.11.2018	32 219 918	CHF	1159.490	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on E.ON N	EUR	1'000.00	15.05.2017	15.11.2018	36 454 023	CHF	1468.160	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	15.05.2017	15.11.2018	36 454 032	CHF	1275.630	97.790	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.08.2017	15.11.2018	36 852 062	%	95.880	100.000	100.000	15.11.	0.000	N
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P 16.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.226%	USD	1'000.00	16.11.2015	16.11.2018	24 875 044		-	96.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 16.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.284%	GBP	1'000.00	16.11.2016	16.11.2018	34 112 897		-	98.750	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	16.05.2017	16.11.2018	36 454 037	CHF	1012.250	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.05.2017	16.11.2018	35 765 833	%	98.580	100.000	100.000	16.08. 16.11.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Indices 17.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.734%	USD	1'000.00	17.11.2016	19.11.2018	32 219 942		-	97.700	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	18.11.2016	19.11.2018	32 219 945	CHF	1156.230	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	18.11.2016	19.11.2018	33 162 833	CHF	1453.320	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	18.05.2017	19.11.2018	36 454 073	CHF	958.070	97.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	19.05.2017	19.11.2018	36 454 077	CHF	1253.860	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	19.05.2017	19.11.2018	36 454 076	CHF	1069.620	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.08.2017	19.11.2018	36 852 069	%	99.020	100.000	100.000	17.11.	0.000	N
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P 20.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.293%	USD	1'000.00	20.11.2015	20.11.2018	28 884 263		-	96.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	23.11.2015	23.11.2018	28 884 265	CHF	1283.400	96.450	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Axa	EUR	1'000.00	23.11.2016	23.11.2018	32 219 970	CHF	1388.710	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	22.05.2017	23.11.2018	36 454 098	CHF	1226.660	97.850	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	23.05.2017	23.11.2018	36 454 114	CHF	1197.200	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.05.2017	23.11.2018	36 454 117	%	99.470	97.870	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	22.11.2017	23.11.2018	38 487 069	CHF	960.610	98.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 24.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.265%	USD	1'000.00	24.11.2015	26.11.2018	28 884 279		-	96.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on HS China Ent Index 27.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.963%	USD	1'000.00	25.11.2015	26.11.2018	28 884 280		-	96.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.173%	GBP	1'000.00	24.11.2016	26.11.2018	32 219 998		-	98.670	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.05.2017	26.11.2018	36 454 147	%	99.600	97.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	25.05.2017	26.11.2018	36 454 161	CHF	1228.590	97.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Crude Oil Barrel	USD	1'000.00	25.05.2017	26.11.2018	35 568 638	CHF	1111.870	97.920	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	25.05.2017	26.11.2018	36 454 162	CHF	1212.660	97.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	25.05.2017	26.11.2018	36 454 159	CHF	1255.050	97.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	25.05.2017	26.11.2018	36 454 160	CHF	1027.920	97.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Telefonica Br	EUR	1'000.00	26.05.2017	26.11.2018	35 765 863	%	100.240	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Indices	USD	1'000.00	26.05.2017	26.11.2018	35 568 629	%	95.000	94.960	97.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 29.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.11.2015	27.11.2018	28 884 262		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	27.11.2017	27.11.2018	38 487 100	CHF	1158.380	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.11.2016	28.11.2018	32 220 006	CHF	1162.460	97.530	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	28.11.2016	28.11.2018	32 220 014	CHF	1216.160	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	28.11.2016	28.11.2018	32 220 015	CHF	1179.930	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 29.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	29.11.2016	29.11.2018	33 162 861		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Axa 28.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	30.11.2016	30.11.2018	32 220 026		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	30.05.2017	30.11.2018	36 454 179	%	99.900	97.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	30.05.2017	30.11.2018	36 454 177	CHF	989.780	97.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	31.05.2017	30.11.2018	36 454 189	CHF	1179.640	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	30.08.2017	30.11.2018	37 823 438	CHF	979.820	98.170	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	30.08.2017	30.11.2018	37 823 439	CHF	962.890	98.170	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	30.08.2017	30.11.2018	37 823 442	CHF	1266.070	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 1.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	01.12.2015	03.12.2018	28 884 319		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	03.12.2015	03.12.2018	28 884 330	CHF	1015.740	96.360	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on TevaPharmInd Sp ADR	USD	1'000.00	01.12.2016	03.12.2018	32 220 028	CHF	497.520	97.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	01.12.2016	03.12.2018	32 220 043	CHF	1157.150	97.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.12.2016	03.12.2018	32 220 048	CHF	1157.490	97.400	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on BP Rg	EUR	1'000.00	03.03.2017	03.12.2018	34 906 747	CHF	1337.030	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 5.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	05.12.2016	05.12.2018	32 220 058		-	97.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 5.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	05.12.2016	05.12.2018	34 112 921		-	97.430	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	05.06.2017	05.12.2018	36 454 214	CHF	1211.940	97.860	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.09.2017	05.12.2018	36 852 112	%	95.620	100.000	100.000	05.12.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	06.12.2016	06.12.2018	32 220 064	CHF	1295.470	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Axa	EUR	1'000.00	06.12.2016	06.12.2018	32 220 065	CHF	1394.870	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.12.2016	06.12.2018	32 220 066	CHF	1437.600	97.420	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.12.2016	06.12.2018	32 220 067	CHF	1378.630	97.420	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.12.2016	06.12.2018	32 220 072	CHF	1452.520	97.420	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.12.2016	06.12.2018	32 220 077	CHF	1157.200	97.420	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	06.12.2016	06.12.2018	32 220 076	CHF	1129.160	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.12.2016	06.12.2018	32 220 079	CHF	1172.710	97.420	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.06.2017	06.12.2018	36 454 230	CHF	1202.140	97.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	06.06.2017	06.12.2018	36 454 229	CHF	1260.710	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.06.2017	06.12.2018	36 454 233	CHF	1180.300	97.880	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.09.2017	06.12.2018	36 852 113	%	97.300	100.000	100.000	06.12.	0.000	N
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	06.12.2017	06.12.2018	38 487 177	CHF	941.040	98.280	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on TevaPharmInd Sp ADR	USD	1'000.00	07.12.2016	07.12.2018	32 220 081	CHF	489.910	97.420	100.000		0.000	Y
7.8 % Reverse Convertible Called for red.on 07.06.17 at 100% 7.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	GBP	1'000.00	07.12.2016	07.12.2018	33 162 858		-	100.000	100.000	07.03. 07.06.	2.008 2.029	N
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	07.12.2016	07.12.2018	32 220 080	CHF	1090.780	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.06.2017	07.12.2018	36 454 245	CHF	1140.070	97.880	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	07.06.2017	07.12.2018	36 454 237	CHF	1225.420	100.000	100.000		0.000	Y
8.25 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.09.2017	07.12.2018	36 852 114	%	98.630	100.000	100.000	07.12.	3.649	N
Reverse Convertible on Indices 9.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	09.12.2015	10.12.2018	30 485 036		-	100.000	100.000		0.000	Y
8.5 % Reverse Convertible on Equities 8.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	08.12.2016	10.12.2018	33 162 852		-	100.000	100.000	08.06. 08.12.	6.528 6.712	N
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	08.12.2016	10.12.2018	32 220 086	CHF	1097.870	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	09.12.2016	10.12.2018	32 220 088	CHF	1183.870	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on AB InBev	EUR	1'000.00	08.06.2017	10.12.2018	36 454 267	CHF	1039.430	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	08.06.2017	10.12.2018	36 454 266	CHF	1132.260	97.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	09.06.2017	10.12.2018	36 454 287	CHF	1182.150	97.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	09.06.2017	10.12.2018	36 454 281	%	102.120	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	09.06.2017	10.12.2018	36 454 283	CHF	1216.950	97.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	08.12.2017	10.12.2018	38 487 194	CHF	1008.440	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	08.12.2017	10.12.2018	38 487 192	CHF	1009.880	98.250	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	08.12.2017	10.12.2018	38 487 191	CHF	968.560	98.250	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	11.12.2015	11.12.2018	30 485 039	%	97.800	91.470	95.000		0.000	Y
Protection Participation on S&P 500	USD	1'000.00	11.12.2015	11.12.2018	30 485 040	%	114.000	91.470	95.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.12.2017	11.12.2018	38 487 196	CHF	952.750	98.250	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.12.2017	11.12.2018	38 487 197	CHF	981.250	98.250	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	12.09.2017	12.12.2018	36 852 129	%	98.650	100.000	100.000	12.12.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	12.12.2017	12.12.2018	38 487 212	CHF	981.000	98.230	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Facebook-A	USD	1'000.00	13.12.2016	13.12.2018	32 220 111	CHF	1490.330	97.380	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Alphabet-A	USD	1'000.00	13.12.2016	13.12.2018	32 220 110	CHF	1319.380	97.380	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Visa-A	USD	1'000.00	13.12.2016	13.12.2018	32 220 112	CHF	1439.520	97.380	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	13.12.2016	13.12.2018	32 220 104	CHF	1199.580	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.06.2017	13.12.2018	36 454 295	CHF	1215.530	97.880	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	13.09.2017	13.12.2018	37 823 547	CHF	1143.950	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on IBEX 35 14.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.185%	USD	1'000.00	14.12.2015	14.12.2018	30 485 045		-	96.220	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Amazon.Com	USD	1'000.00	14.12.2016	14.12.2018	32 220 117	CHF	1521.810	97.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 17.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.854%	USD	1'000.00	17.12.2015	17.12.2018	30 485 054		-	96.230	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	15.12.2016	17.12.2018	32 220 119	CHF	1312.530	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	15.12.2016	17.12.2018	32 220 121	CHF	1137.610	97.390	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	15.12.2016	17.12.2018	32 220 122	CHF	1224.710	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	15.06.2017	17.12.2018	36 454 318	CHF	1132.650	97.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	16.06.2017	17.12.2018	36 454 324	CHF	1117.010	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 20.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.922%	USD	1'000.00	18.12.2015	18.12.2018	30 485 057		-	96.300	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	18.09.2017	18.12.2018	37 823 608	CHF	1184.680	100.000	100.000		0.000	Y
5.25 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	19.06.2017	19.12.2018	35 765 889	%	99.790	100.000	100.000	19.09. 19.12.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.06.2017	19.12.2018	36 454 346	CHF	1162.030	97.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.06.2017	19.12.2018	36 454 341	CHF	1175.200	97.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.09.2017	19.12.2018	37 823 630	CHF	796.900	98.190	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.09.2017	19.12.2018	37 823 626	CHF	1042.730	98.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Clariant N	CHF	21.10	11.10.2017	19.12.2018	38 064 827	CHF	22.400	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	20.06.2017	20.12.2018	36 454 359	CHF	913.570	97.810	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	20.09.2017	20.12.2018	37 823 651	CHF	1024.430	98.180	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	21.12.2016	21.12.2018	34 906 032	CHF	1151.490	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	21.06.2017	21.12.2018	36 454 361	CHF	937.820	97.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 26.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.068%	USD	1'000.00	25.06.2015	26.12.2018	25 233 072		-	95.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	26.09.2017	26.12.2018	37 823 697	CHF	876.270	98.100	100.000		0.000	Y
6.45 % Reverse Convertible on Indices 27.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	27.12.2016	27.12.2018	34 906 056		-	100.000	100.000	27.03. 27.06. 27.09. 27.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	27.06.2017	27.12.2018	35 568 654	%	128.600	97.810	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	27.06.2017	27.12.2018	36 454 407	CHF	1134.750	97.810	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.06.2017	28.12.2018	36 454 418	CHF	1173.980	97.810	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	28.09.2017	28.12.2018	37 823 762	CHF	1199.180	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	28.09.2017	28.12.2018	37 823 735	CHF	993.800	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.09.2017	28.12.2018	37 823 752	CHF	882.840	98.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	29.06.2015	31.12.2018	25 233 086	%	99.770	95.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	30.06.2015	31.12.2018	25 233 093	%	99.330	95.240	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Commodities-Basket	GBP	1'000.00	29.12.2015	31.12.2018	30 112 541	CHF	1646.500	96.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	30.12.2015	31.12.2018	30 485 051	CHF	1295.350	99.940	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	30.06.2017	31.12.2018	36 454 454	CHF	1004.110	97.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.06.2017	31.12.2018	36 454 457	%	84.320	97.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.07.2017	03.01.2019	36 454 464	CHF	1111.730	97.820	100.000		0.000	Y
ProNote with Participation on FTSE 100	GBP	1'000.00	06.01.2014	07.01.2019	23 071 317	%	109.100	90.210	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI-Index	USD	1'000.00	05.01.2016	07.01.2019	30 112 543	%	103.900	95.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Micron Technolog Rg	USD	1'000.00	06.07.2017	07.01.2019	36 454 480	%	102.040	97.780	100.000		0.000	Y
Protection Participation on S&P 500	USD	1'000.00	10.01.2017	10.01.2019	34 906 087	%	110.000	92.190	95.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	1'000.00	11.01.2017	11.01.2019	34 906 104	CHF	1115.400	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.01.2017	11.01.2019	34 906 101	CHF	1092.090	97.070	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Total	EUR	1'000.00	11.01.2017	11.01.2019	34 906 099	CHF	1244.020	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.07.2017	11.01.2019	36 454 512	CHF	1166.170	97.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 13.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.242%	USD	1'000.00	13.01.2016	14.01.2019	30 485 102		-	96.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 17.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.109%	USD	1'000.00	14.01.2016	14.01.2019	30 485 116		-	96.210	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 16.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	14.01.2016	14.01.2019	30 485 112		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	12.01.2017	14.01.2019	34 906 122	CHF	1069.470	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	12.01.2017	14.01.2019	34 906 119	CHF	1164.750	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	12.01.2017	14.01.2019	34 906 114	CHF	1352.680	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	12.01.2017	14.01.2019	34 906 112	CHF	1152.990	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	13.01.2017	14.01.2019	34 906 125	CHF	1040.550	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	13.01.2017	14.01.2019	34 906 123	CHF	1167.200	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.07.2017	14.01.2019	36 454 528	%	100.210	97.700	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.07.2017	14.01.2019	36 454 546	CHF	1173.650	97.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	12.10.2017	14.01.2019	38 486 571	CHF	778.880	98.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 17.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.297%	USD	1'000.00	15.01.2016	15.01.2019	30 485 114		-	96.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 17.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.105%	USD	1'000.00	15.01.2016	15.01.2019	30 485 123		-	96.210	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	1'000.00	16.01.2017	16.01.2019	34 906 135	CHF	1109.180	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	16.01.2017	16.01.2019	34 906 138	CHF	1449.000	100.000	100.000		0.000	Y
ProNote with Participation on FTSE 100	GBP	1'000.00	17.01.2014	17.01.2019	23 071 320	%	108.300	90.040	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	17.01.2017	17.01.2019	34 906 154	CHF	1296.050	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Linde	EUR	1'000.00	17.01.2017	17.01.2019	34 906 162	CHF	1366.620	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nestle N	EUR	1'000.00	17.01.2017	17.01.2019	34 906 160	CHF	1321.360	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.01.2017	17.01.2019	34 906 132	%	104.280	97.110	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	17.01.2017	17.01.2019	34 906 153	CHF	1091.030	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	17.01.2017	17.01.2019	34 906 167	CHF	1289.650	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	17.01.2017	17.01.2019	34 906 156	CHF	1261.360	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.01.2017	17.01.2019	34 906 141	CHF	1166.040	97.110	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.01.2017	17.01.2019	34 906 142	CHF	1069.800	97.110	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.01.2017	17.01.2019	34 906 144	CHF	1125.290	97.110	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	1'000.00	17.01.2017	17.01.2019	34 906 149	CHF	1106.480	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.07.2017	17.01.2019	36 454 558	CHF	1176.430	97.690	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on HS China Ent Index	USD	1'000.00	18.01.2017	18.01.2019	34 906 145	CHF	1151.290	97.120	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	18.01.2017	18.01.2019	34 906 169	CHF	1089.020	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on VMware-A	USD	1'000.00	18.01.2017	18.01.2019	34 906 157	CHF	1478.260	97.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 18.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.37%	USD	1'000.00	18.01.2017	18.01.2019	34 906 102		-	97.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 18.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.953%	USD	1'000.00	18.01.2017	18.01.2019	34 906 180		-	97.100	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	1'000.00	18.04.2017	18.01.2019	36 044 357	CHF	1090.320	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	20.01.2017	21.01.2019	34 906 219	CHF	1146.050	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	20.07.2017	21.01.2019	36 454 600	CHF	1300.200	100.000	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	22.01.2015	22.01.2019	24 439 861	%	101.900	100.000	100.000	23.01. 24.04. 22.07. 22.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Indices 19.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.965%	USD	1'000.00	19.01.2017	22.01.2019	34 906 197		-	97.120	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Schlumberger	USD	1'000.00	19.01.2017	22.01.2019	34 906 176	CHF	793.430	97.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 20.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.35%	USD	1'000.00	20.01.2017	22.01.2019	34 906 196		-	97.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 20.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.35%	USD	1'000.00	20.01.2017	22.01.2019	34 906 194		-	97.100	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	19.07.2017	22.01.2019	36 454 583	CHF	959.610	97.700	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	21.12.2017	22.01.2019	37 357 533	CHF	949.130	98.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on iShs MSCI Em Mk	USD	1'000.00	22.12.2017	22.01.2019	37 357 534	CHF	993.960	98.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 24.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	23.01.2017	23.01.2019	34 906 143		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 24.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.374%	USD	1'000.00	23.01.2017	23.01.2019	34 906 137		-	97.120	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Caterpillar	USD	1'000.00	23.01.2017	23.01.2019	34 906 217	CHF	1604.310	97.140	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Swiss Re N	CHF	1'000.00	23.01.2017	23.01.2019	34 906 222	CHF	1027.710	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	24.01.2017	24.01.2019	34 906 231	CHF	1130.580	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 24.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.982%	USD	1'000.00	24.01.2017	24.01.2019	34 906 249		-	97.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	24.01.2017	24.01.2019	34 906 229	%	100.200	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on JPMorgan Chase	USD	1'000.00	24.01.2017	24.01.2019	34 906 243	CHF	1216.380	97.060	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	1'000.00	24.01.2017	24.01.2019	34 906 228	CHF	1132.590	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	25.01.2017	25.01.2019	34 906 252	CHF	1182.770	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	25.01.2017	25.01.2019	34 906 256	CHF	1054.560	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 25.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.968%	USD	1'000.00	25.01.2017	25.01.2019	34 906 175		-	97.120	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	25.01.2017	25.01.2019	34 906 251	CHF	1128.140	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Citigroup Rg	USD	1'000.00	25.01.2017	25.01.2019	34 906 260	CHF	1245.200	97.140	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	EUR	1'000.00	25.10.2017	25.01.2019	38 486 749	CHF	1137.530	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	26.01.2017	28.01.2019	34 906 265	CHF	1099.750	97.120	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	26.01.2017	28.01.2019	34 906 268	CHF	1391.640	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on BASF N	EUR	1'000.00	26.01.2017	28.01.2019	34 906 269	CHF	1225.150	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Merck Rg	USD	1'000.00	27.01.2017	28.01.2019	34 906 281	CHF	923.850	96.960	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Lvmh	EUR	1'000.00	27.01.2017	28.01.2019	34 906 280	CHF	1512.090	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	27.01.2017	28.01.2019	34 906 279	CHF	1075.660	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	1'000.00	27.01.2017	28.01.2019	34 906 278	CHF	1160.030	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.07.2017	28.01.2019	36 454 681	CHF	1102.580	97.750	100.000		0.000	Y
4 1/2 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	29.01.2016	29.01.2019	30 012 883		-	100.000	100.000	30.01. 28.04.	0.000 0.000	N
28.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	30.01.2017	30.01.2019	34 906 296	CHF	1345.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	30.01.2017	30.01.2019	34 906 288	CHF	1274.760	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	30.01.2017	30.01.2019	34 906 289	CHF	1252.480	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Microsoft Rg	USD	1'000.00	31.01.2017	31.01.2019	34 906 307	CHF	1314.930	97.100	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Microsoft Rg	USD	1'000.00	31.01.2017	31.01.2019	34 906 308	CHF	1319.020	97.100	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	31.07.2017	31.01.2019	36 454 684	CHF	983.620	97.730	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	31.10.2017	31.01.2019	38 486 822	CHF	757.140	97.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on General Electric Rg	USD	1'000.00	31.10.2017	31.01.2019	38 486 827	CHF	757.230	97.950	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Crude Oil	USD	1'000.00	01.02.2016	01.02.2019	30 112 563	%	123.600	92.020	95.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	01.02.2017	01.02.2019	34 906 348	CHF	1070.630	97.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur Grp N	CHF	1'000.00	01.02.2017	01.02.2019	34 906 324	CHF	1086.070	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	01.02.2017	01.02.2019	34 906 325	CHF	1114.480	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	01.02.2017	01.02.2019	34 906 339	CHF	1129.150	97.080	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Gazprom Sp ADR	USD	1'000.00	01.02.2017	01.02.2019	34 906 323	CHF	897.900	97.080	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	01.02.2017	01.02.2019	34 906 346	CHF	1179.650	97.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Medtronic	USD	1'000.00	01.02.2017	01.02.2019	34 906 336	CHF	1075.660	97.080	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	01.08.2017	01.02.2019	36 454 693	CHF	974.470	97.700	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	03.02.2016	04.02.2019	30 012 904	%	104.810	97.120	100.000		0.000	N
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	04.02.2016	04.02.2019	30 485 257	CHF	1351.810	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation	USD	1'000.00	04.02.2016	04.02.2019	30 112 570	%	104.200	96.970	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	04.02.2016	04.02.2019	30 485 258	CHF	1103.130	96.720	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	02.02.2017	04.02.2019	34 906 358	CHF	1147.770	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur Grp N	CHF	1'000.00	02.02.2017	04.02.2019	34 906 368	CHF	1076.460	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on AXA P	EUR	1'000.00	02.02.2017	04.02.2019	34 906 369	CHF	1287.360	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.02.2017	04.02.2019	34 906 365	CHF	1120.030	97.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.02.2017	04.02.2019	34 906 367	CHF	1074.690	96.990	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.02.2017	04.02.2019	34 906 355	CHF	1097.670	97.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Total	EUR	1'000.00	02.02.2017	04.02.2019	34 906 357	CHF	1228.900	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	1'000.00	02.02.2017	04.02.2019	34 906 370	CHF	1142.790	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	02.02.2017	04.02.2019	34 906 371	CHF	1057.540	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on AXA P	EUR	1'000.00	03.02.2017	04.02.2019	34 906 390	CHF	1295.010	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	03.02.2017	04.02.2019	34 906 384	CHF	1108.350	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Rio Tinto Rg	USD	1'000.00	03.02.2017	04.02.2019	34 906 377	CHF	1010.380	96.990	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	03.02.2017	04.02.2019	34 906 385	CHF	1188.270	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	02.08.2017	04.02.2019	36 454 701	CHF	974.990	97.720	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Orange	EUR	1'000.00	04.08.2017	04.02.2019	36 454 738	CHF	1186.500	100.000	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.11.2017	04.02.2019	38 064 856	%	95.700	100.000	100.000		0.000	N
Reverse Convertible on General Electric Rg	USD	15.92	05.12.2017	04.02.2019	38 064 939	CHF	15.250	97.970	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.02.2017	06.02.2019	34 906 402	CHF	1111.680	97.060	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.02.2017	06.02.2019	34 906 400	CHF	1123.810	97.060	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.02.2017	06.02.2019	34 906 399	CHF	1082.900	97.060	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.02.2017	06.02.2019	34 906 398	CHF	1185.640	97.060	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.02.2017	07.02.2019	34 906 424	CHF	1116.760	97.090	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.02.2017	07.02.2019	34 906 410	CHF	1190.440	97.060	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	07.02.2017	07.02.2019	34 906 408	CHF	1077.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	07.02.2017	07.02.2019	34 906 405	CHF	1345.110	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.02.2017	07.02.2019	34 906 423	CHF	1079.160	97.090	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.02.2017	07.02.2019	34 906 420	CHF	1188.490	97.090	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.02.2017	07.02.2019	34 906 418	CHF	1115.410	97.090	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.02.2017	07.02.2019	34 906 413	CHF	1118.990	97.060	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.02.2017	07.02.2019	34 906 412	CHF	1079.760	97.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 8.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.02.2016	08.02.2019	30 012 918		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	08.02.2017	08.02.2019	34 906 430	CHF	1110.950	97.090	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	08.02.2017	08.02.2019	34 906 431	CHF	1113.040	97.090	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	08.02.2017	08.02.2019	34 906 426	CHF	1125.630	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ING Group Rg	EUR	1'000.00	08.02.2017	08.02.2019	34 906 433	CHF	1364.480	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Medtronic	USD	1'000.00	08.02.2017	08.02.2019	34 906 441	CHF	1046.910	97.090	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	08.02.2017	08.02.2019	34 906 442	CHF	883.920	97.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 8.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.89%	USD	1'000.00	08.02.2017	08.02.2019	34 906 338		-	97.010	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	10.08.2016	11.02.2019	31 883 911	CHF	1095.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Total	EUR	1'000.00	09.02.2017	11.02.2019	34 906 463	CHF	1238.330	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Intesa Sanpaolo	EUR	1'000.00	09.02.2017	11.02.2019	34 906 460	CHF	1445.320	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	09.02.2017	11.02.2019	34 906 455	CHF	1227.100	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	09.02.2017	11.02.2019	34 906 454	CHF	1133.770	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	09.02.2017	11.02.2019	34 906 452	CHF	1135.650	96.990	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	09.02.2017	11.02.2019	34 906 450	CHF	985.040	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	10.02.2017	11.02.2019	34 906 486	CHF	1219.510	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur Grp N	CHF	1'000.00	10.02.2017	11.02.2019	34 906 472	CHF	1071.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Apple	USD	1'000.00	10.02.2017	11.02.2019	34 906 480	CHF	1272.060	97.070	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	10.02.2017	11.02.2019	34 906 485	CHF	1347.250	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.02.2017	11.02.2019	34 906 488	CHF	1082.730	97.110	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.08.2017	11.02.2019	36 454 779	CHF	907.880	97.730	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	10.08.2017	11.02.2019	36 454 780	CHF	1055.500	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.02.2017	13.02.2019	34 906 501	CHF	826.750	97.090	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.02.2017	13.02.2019	34 906 500	CHF	1094.140	97.090	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.02.2017	13.02.2019	34 906 499	CHF	1122.180	97.090	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.02.2017	13.02.2019	34 906 498	CHF	1106.100	97.110	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	14.02.2017	14.02.2019	34 906 510	CHF	1314.800	97.090	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	14.02.2017	14.02.2019	34 906 511	CHF	719.230	97.090	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Macy's Rg	USD	1'000.00	14.02.2017	14.02.2019	34 906 515	CHF	755.020	97.090	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	14.02.2017	14.02.2019	34 906 516	CHF	1311.340	97.090	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	14.02.2017	14.02.2019	34 906 517	CHF	1114.970	97.090	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Bayer N	EUR	1'000.00	14.02.2017	14.02.2019	34 906 518	CHF	1214.480	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Airbus Group	EUR	1'000.00	14.02.2017	14.02.2019	34 906 519	CHF	1554.400	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 14.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.946%	USD	1'000.00	14.02.2017	14.02.2019	35 568 568		-	97.090	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	15.02.2017	15.02.2019	34 906 538	CHF	1272.400	97.080	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on AXA P	EUR	1'000.00	15.02.2017	15.02.2019	34 906 528	CHF	1336.270	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Bayer N	EUR	1'000.00	15.02.2017	15.02.2019	34 906 527	CHF	1228.240	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	15.02.2017	15.02.2019	34 906 533	CHF	1345.670	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	15.02.2017	15.02.2019	34 906 539	CHF	891.590	97.080	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	15.05.2017	15.02.2019	36 454 031	CHF	1133.780	97.330	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Daimler N	EUR	1'000.00	15.08.2017	15.02.2019	36 454 801	CHF	1331.470	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	16.02.2016	18.02.2019	30 485 292	CHF	1482.070	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	16.02.2016	18.02.2019	30 485 293	CHF	1479.080	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	16.02.2017	18.02.2019	34 906 549	CHF	1060.540	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur Gr N	CHF	1'000.00	16.02.2017	18.02.2019	34 906 551	CHF	1111.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Sanofi	EUR	1'000.00	17.02.2017	18.02.2019	34 906 557	CHF	1108.710	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Airbus Br	EUR	1'000.00	17.02.2017	18.02.2019	34 906 556	CHF	1526.190	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	17.02.2017	18.02.2019	34 906 567	CHF	1055.380	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	17.02.2017	18.02.2019	34 906 564	CHF	1409.640	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	17.02.2017	18.02.2019	34 906 565	CHF	1098.790	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	17.02.2017	18.02.2019	34 906 559	CHF	1020.010	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Total	EUR	1'000.00	17.02.2017	18.02.2019	34 906 558	CHF	1228.850	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	16.08.2017	18.02.2019	36 454 809	CHF	1038.690	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	17.11.2017	18.02.2019	38 486 996	CHF	963.700	100.000	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	19.02.2015	19.02.2019	24 874 669	%	101.570	100.000	100.000	20.02. 19.05. 21.08. 20.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Protection Participation	USD	1'000.00	19.02.2016	19.02.2019	31 562 193	%	99.400	97.380	100.000		0.000	Y
5.625 % Reverse Convertible on Indices 20.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.02.2016	19.02.2019	30 012 921		-	100.000	100.000	20.02.	0.000	N
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	17.02.2017	19.02.2019	34 906 554	CHF	1118.950	97.100	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	17.02.2017	19.02.2019	34 906 562	CHF	1056.280	97.100	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	20.02.2017	20.02.2019	34 906 574	CHF	1229.020	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CS Group N	CHF	1'000.00	21.02.2017	21.02.2019	34 906 586	CHF	1228.250	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on NASDAQ 100	USD	1'000.00	22.02.2017	22.02.2019	34 906 583	CHF	1181.240	97.020	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	22.02.2017	22.02.2019	34 906 611	CHF	1338.270	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 22.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.995%	USD	1'000.00	22.08.2017	22.02.2019	37 823 389		-	97.730	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	25.02.2015	25.02.2019	25 232 388	%	105.800	99.050	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	23.02.2017	25.02.2019	34 906 629	CHF	1197.870	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	23.02.2017	25.02.2019	34 906 628	CHF	1097.050	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	23.02.2017	25.02.2019	34 906 632	CHF	1276.820	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	23.02.2017	25.02.2019	34 906 624	CHF	1103.740	96.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	23.02.2017	25.02.2019	34 906 606	CHF	1242.770	96.960	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	23.02.2017	25.02.2019	34 906 605	CHF	1296.390	96.960	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	23.02.2017	25.02.2019	34 906 626	CHF	1307.300	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	24.02.2017	25.02.2019	34 906 654	CHF	1055.920	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	24.08.2017	25.02.2019	37 823 399	CHF	925.730	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Siemens N	EUR	1'000.00	24.08.2017	25.02.2019	37 823 402	CHF	1187.850	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Crude Oil	USD	1'000.00	23.02.2016	26.02.2019	31 562 198	%	104.000	92.430	95.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	26.05.2017	26.02.2019	36 454 167	CHF	1239.500	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur Gr N	CHF	1'000.00	28.02.2017	28.02.2019	34 906 669	CHF	1090.150	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Engie	EUR	1'000.00	28.02.2017	28.02.2019	34 906 671	CHF	1499.030	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	28.02.2017	28.02.2019	34 906 670	CHF	1015.590	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Banco Santander Rg 29.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	28.02.2017	28.02.2019	34 906 675		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	28.02.2017	28.02.2019	34 906 672	CHF	1174.800	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	28.02.2017	28.02.2019	34 906 686	CHF	1019.180	96.920	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	1'000.00	29.08.2017	28.02.2019	37 823 425	CHF	1008.760	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	29.08.2017	28.02.2019	37 823 424	CHF	948.600	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 1.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.895%	USD	1'000.00	01.03.2016	01.03.2019	30 485 338		-	97.250	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Total	USD	1'000.00	01.03.2017	01.03.2019	34 906 696	CHF	1008.250	96.920	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	01.03.2017	01.03.2019	34 906 713	CHF	1096.380	96.940	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	USD	1'000.00	01.03.2017	01.03.2019	34 906 688	CHF	1104.150	96.920	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Sanofi	EUR	1'000.00	01.03.2017	01.03.2019	34 906 690	CHF	1081.940	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	01.03.2017	01.03.2019	34 906 691	CHF	1197.710	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on AXA P 1.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	01.03.2017	01.03.2019	34 906 692		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	1'000.00	01.03.2017	01.03.2019	34 906 693	CHF	1126.930	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	USD	1'000.00	01.03.2017	01.03.2019	34 906 694	CHF	1003.350	96.920	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	01.03.2017	01.03.2019	34 906 695	CHF	1225.170	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.03.2017	01.03.2019	34 906 674	%	100.430	96.970	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Total	USD	1'000.00	01.03.2017	01.03.2019	34 906 697	CHF	1004.860	96.920	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	01.03.2017	01.03.2019	34 906 698	CHF	1097.490	96.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.845%	USD	1'000.00	01.03.2017	01.03.2019	34 906 700		-	96.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.03.2017	01.03.2019	34 906 705	%	94.780	96.920	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Pfizer Rg	USD	1'000.00	01.03.2017	01.03.2019	34 906 707	CHF	1055.440	96.920	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on JPMorgan Chase Rg	USD	1'000.00	01.03.2017	01.03.2019	34 906 708	CHF	1138.330	96.920	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	01.09.2017	01.03.2019	37 823 472	CHF	1203.780	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	01.09.2017	01.03.2019	37 823 477	CHF	1044.330	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	02.03.2015	04.03.2019	25 232 443	CHF	1087.880	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.03.2017	04.03.2019	34 906 726	CHF	1017.300	96.940	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.03.2017	04.03.2019	34 906 724	CHF	1016.400	96.940	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Sanofi	EUR	1'000.00	02.03.2017	04.03.2019	34 906 715	CHF	1084.640	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur Gr N	CHF	1'000.00	02.03.2017	04.03.2019	34 906 717	CHF	1110.090	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	02.03.2017	04.03.2019	34 906 719	CHF	1224.120	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.03.2017	04.03.2019	34 906 753	CHF	1250.630	96.980	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.03.2017	04.03.2019	34 906 752	CHF	1298.860	96.980	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	03.03.2017	04.03.2019	34 906 748	CHF	1234.340	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	03.03.2017	04.03.2019	34 906 744	CHF	1326.160	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	03.03.2017	04.03.2019	34 906 763	CHF	1132.870	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	03.03.2017	04.03.2019	34 906 765	CHF	1172.600	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.03.2017	04.03.2019	34 906 757	CHF	1287.290	96.980	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.03.2017	04.03.2019	34 906 768	CHF	801.690	97.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	05.09.2017	05.03.2019	37 823 486	CHF	1034.600	97.760	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	06.03.2017	06.03.2019	34 906 769	CHF	1046.610	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on AB InBev Rg	EUR	1'000.00	06.03.2017	06.03.2019	34 906 773	CHF	1095.340	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	06.03.2017	06.03.2019	34 906 785	CHF	1586.430	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.296%	USD	1'000.00	06.03.2017	06.03.2019	34 906 778		-	97.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Sanofi	EUR	1'000.00	06.03.2017	06.03.2019	34 906 772	CHF	1082.920	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.03.2017	06.03.2019	34 906 779	CHF	1012.950	97.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.09.2017	06.03.2019	37 823 498	CHF	1032.570	97.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Banco Santander Rg 7.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	07.03.2017	07.03.2019	34 906 793		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Sanofi	EUR	1'000.00	07.03.2017	07.03.2019	34 906 815	CHF	1072.780	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Swisscom N	CHF	1'000.00	07.03.2017	07.03.2019	34 906 818	CHF	1168.350	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	07.03.2017	07.03.2019	34 906 812	CHF	1042.370	97.010	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Sanofi	EUR	1'000.00	07.03.2017	07.03.2019	34 906 814	CHF	1073.300	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.03.2017	07.03.2019	34 906 807	CHF	1244.900	97.010	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur Gr N	CHF	1'000.00	07.03.2017	07.03.2019	34 906 799	CHF	1103.610	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.09.2017	07.03.2019	37 823 509	CHF	1104.880	97.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 8.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.795%	USD	1'000.00	08.03.2016	08.03.2019	30 485 365		-	97.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.859%	USD	1'000.00	08.03.2017	08.03.2019	34 906 701		-	96.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Total	EUR	1'000.00	08.03.2017	08.03.2019	34 906 828	CHF	1209.150	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Sanofi	EUR	1'000.00	08.03.2017	08.03.2019	34 906 825	CHF	1076.080	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	1'000.00	08.03.2017	08.03.2019	34 906 824	CHF	1120.170	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	08.09.2017	08.03.2019	37 823 524	CHF	1075.780	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	08.09.2017	08.03.2019	37 823 525	CHF	941.200	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	08.12.2017	08.03.2019	38 487 193	CHF	959.790	97.760	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Indices	USD	1'000.00	10.03.2016	11.03.2019	31 562 209	%	107.700	97.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Societe Generale 9.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	09.03.2017	11.03.2019	34 906 842		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 9.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.24%	USD	1'000.00	09.03.2017	11.03.2019	34 906 733		-	96.970	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	09.03.2017	11.03.2019	34 906 848	CHF	964.670	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on AXA 11.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	09.03.2017	11.03.2019	34 906 843		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on AB InBev Rg	EUR	1'000.00	09.03.2017	11.03.2019	34 906 845	CHF	1117.610	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on AXA	EUR	1'000.00	09.03.2017	11.03.2019	34 906 844	CHF	1290.570	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	10.03.2017	11.03.2019	34 906 866	CHF	1030.620	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Total	EUR	1'000.00	09.06.2017	11.03.2019	36 454 273	CHF	1184.670	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	11.09.2017	11.03.2019	37 823 528	CHF	970.340	97.810	100.000		0.000	Y
1.55 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	12.03.2015	12.03.2019	24 874 707	%	100.800	100.000	100.000	13.03. 12.06. 12.09. 12.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker on UBS Group N	CHF	1'000.00	13.03.2017	13.03.2019	34 906 876	CHF	1128.560	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.03.2017	13.03.2019	34 906 884	CHF	1046.070	96.750	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.03.2017	13.03.2019	34 906 883	CHF	1009.440	96.750	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Sanofi	EUR	1'000.00	13.03.2017	13.03.2019	34 906 870	CHF	1064.360	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Airbus Br	EUR	1'000.00	13.03.2017	13.03.2019	34 906 871	CHF	1388.130	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.03.2017	13.03.2019	34 906 885	CHF	1138.970	96.750	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	13.03.2017	13.03.2019	34 906 879	CHF	1184.840	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nokia Rg	EUR	1'000.00	13.03.2017	13.03.2019	34 906 881	CHF	934.320	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Iberdrola	EUR	1'000.00	13.03.2017	13.03.2019	34 906 882	CHF	1188.020	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.09.2017	13.03.2019	37 823 583	CHF	1154.550	97.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	13.09.2017	13.03.2019	37 823 567	CHF	1053.960	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.12.2017	13.03.2019	38 487 230	CHF	951.270	97.720	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	14.03.2017	14.03.2019	34 906 903	CHF	791.960	96.790	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	14.03.2017	14.03.2019	34 906 904	CHF	1201.140	96.790	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	14.03.2017	14.03.2019	34 906 905	CHF	1049.780	96.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Banco Santander Rg 14.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	14.03.2017	14.03.2019	34 906 912		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Glencore Rg	USD	1'000.00	14.03.2017	14.03.2019	34 906 913	CHF	1149.680	96.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.141%	USD	1'000.00	14.03.2017	14.03.2019	34 906 817		-	96.860	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 14.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.753%	USD	1'000.00	14.03.2017	14.03.2019	35 568 589		-	96.800	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CS Group N	CHF	1'000.00	14.03.2017	14.03.2019	34 906 895	CHF	1226.520	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	14.03.2017	14.03.2019	34 906 901	CHF	1061.560	96.790	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	CHF	1'000.00	15.03.2016	15.03.2019	30 485 375	CHF	1267.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Bank of America Rg	USD	1'000.00	15.03.2017	15.03.2019	34 906 920	CHF	1123.290	96.790	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	15.03.2017	15.03.2019	34 906 925	CHF	1091.410	96.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.03.2017	15.03.2019	34 906 929	%	98.900	96.740	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	15.03.2017	15.03.2019	34 906 917	CHF	977.630	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CS Group N	USD	1'000.00	15.03.2017	15.03.2019	34 906 916	CHF	1173.800	96.790	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	15.03.2017	15.03.2019	34 906 919	CHF	1092.560	96.790	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	15.03.2017	15.03.2019	34 906 935	CHF	626.870	96.740	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	15.03.2017	15.03.2019	34 906 934	CHF	1132.150	96.740	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	15.03.2017	15.03.2019	34 906 933	CHF	997.540	96.740	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Vinci	EUR	1'000.00	15.03.2017	15.03.2019	34 906 928	CHF	1423.230	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	15.09.2017	15.03.2019	37 823 600	CHF	967.740	97.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Lonza Grp N	CHF	236.00	19.10.2017	15.03.2019	38 064 843	CHF	233.700	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	16.03.2017	18.03.2019	34 906 950	CHF	1041.090	96.740	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	16.03.2017	18.03.2019	34 906 936	CHF	988.780	96.740	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	16.03.2017	18.03.2019	34 906 953	CHF	1039.860	96.740	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	16.03.2017	18.03.2019	34 906 955	CHF	1054.270	96.700	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	16.03.2017	18.03.2019	34 906 957	CHF	1091.110	96.700	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	16.03.2017	18.03.2019	34 906 952	CHF	986.320	96.740	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	16.03.2017	18.03.2019	34 906 949	CHF	1143.560	96.740	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 18.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	16.03.2017	18.03.2019	34 906 849		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	16.03.2017	18.03.2019	34 906 948	CHF	549.110	96.740	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	16.03.2017	18.03.2019	34 906 944	CHF	1310.760	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.03.2017	18.03.2019	34 906 971	CHF	937.520	96.700	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	17.03.2017	18.03.2019	34 906 983	CHF	1091.890	96.700	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	17.03.2017	18.03.2019	34 906 973	CHF	1074.310	100.000	100.000		0.000	Y
2.05 % Credit Linked Notes with credit risk on Petrobas	CHF	1'000.00	02.04.2014	20.03.2019	23 651 561	%	100.620	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	5.125 5.125 5.125 5.125	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.03.2017	20.03.2019	34 906 995	%	99.770	96.700	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	20.03.2017	20.03.2019	34 907 003	CHF	1112.150	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	20.03.2017	20.03.2019	34 906 993	CHF	1182.980	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ING Group Rg	EUR	1'000.00	20.03.2017	20.03.2019	34 906 986	CHF	1274.990	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	20.03.2017	20.03.2019	34 906 992	CHF	1329.780	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	20.03.2017	20.03.2019	34 906 996	CHF	1176.020	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	21.03.2017	21.03.2019	34 907 023	CHF	1080.690	96.670	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	21.03.2017	21.03.2019	34 907 013	CHF	1019.510	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	21.03.2017	21.03.2019	34 907 027	CHF	927.040	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	1'000.00	21.03.2017	21.03.2019	34 907 025	CHF	1061.580	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	21.09.2017	21.03.2019	37 823 669	CHF	1021.420	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	21.09.2017	21.03.2019	37 823 670	CHF	1020.970	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur Gr N	CHF	1'000.00	22.03.2017	22.03.2019	36 043 986	CHF	1070.290	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	22.03.2017	22.03.2019	36 043 989	CHF	1007.470	96.670	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Blackrock	USD	1'000.00	22.03.2017	22.03.2019	36 043 988	CHF	1279.160	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Iberdrola	EUR	1'000.00	22.03.2017	22.03.2019	36 043 980	CHF	1194.050	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	22.03.2017	22.03.2019	36 043 999	CHF	1150.680	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Eni N	EUR	1'000.00	22.03.2017	22.03.2019	36 043 993	CHF	1195.310	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	22.03.2017	22.03.2019	36 043 992	CHF	1364.970	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Amazon.Com Rg	USD	1'000.00	22.09.2017	22.03.2019	37 823 679	%	100.980	97.710	100.000		0.000	Y
4.20 % p.a. Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	25.03.2015	25.03.2019	24 874 724	%	100.540	100.000	100.000	25.03. 26.06. 25.09. 25.12.	3.343 3.299 3.294 3.364	N
Reverse Convertible on Indices 26.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.368%	USD	1'000.00	24.09.2015	25.03.2019	28 884 110		-	95.580	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.03.2017	25.03.2019	36 044 020	%	101.600	96.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	23.03.2017	25.03.2019	36 044 009	CHF	1029.420	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.03.2017	25.03.2019	36 044 042	CHF	969.960	96.790	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.03.2017	25.03.2019	36 044 040	CHF	1125.590	96.790	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.03.2017	25.03.2019	36 044 039	CHF	1043.360	96.790	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	24.03.2017	25.03.2019	36 044 031	CHF	1183.230	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	24.03.2017	25.03.2019	36 044 029	CHF	1137.140	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nokia Rg	EUR	1'000.00	24.03.2017	25.03.2019	36 044 035	CHF	868.850	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Philip Mrrs Int Rg	USD	1'000.00	26.09.2017	26.03.2019	37 823 701	CHF	891.620	97.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on UBS Group N	CHF	1'000.00	27.03.2017	27.03.2019	36 044 073	CHF	1137.290	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 27.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.977%	USD	1'000.00	27.03.2017	27.03.2019	34 906 987		-	96.680	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 28.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.739%	USD	1'000.00	28.03.2017	28.03.2019	36 044 084		-	96.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	28.03.2017	28.03.2019	36 044 083	%	100.980	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Blackrock	USD	1'000.00	28.03.2017	28.03.2019	36 044 082	CHF	1296.400	96.790	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nokia Rg	EUR	1'000.00	28.03.2017	28.03.2019	36 044 078	CHF	881.540	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roy.Philips Br	EUR	1'000.00	28.03.2017	28.03.2019	36 044 077	CHF	1268.520	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	1'000.00	29.03.2017	29.03.2019	36 044 099	CHF	1100.140	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	29.03.2017	29.03.2019	36 044 108	CHF	1224.640	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	30.03.2017	29.03.2019	36 044 116	CHF	1007.110	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	30.03.2017	29.03.2019	36 044 114	CHF	1124.940	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 29.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.764%	USD	1'000.00	30.03.2017	29.03.2019	36 044 126		-	96.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.03.2017	29.03.2019	36 044 125	%	101.550	96.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.03.2017	29.03.2019	36 044 122	%	98.070	96.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nokia Rg	EUR	1'000.00	30.03.2017	29.03.2019	36 044 128	CHF	889.810	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.03.2017	29.03.2019	36 044 129	%	100.630	96.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 29.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.785%	USD	1'000.00	30.03.2017	29.03.2019	36 044 124		-	96.850	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on AXA	EUR	1'000.00	30.03.2017	29.03.2019	36 044 132	CHF	1270.640	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Blackrock	USD	1'000.00	31.03.2017	29.03.2019	36 044 177	CHF	1304.890	96.840	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on The Swatch Grp I	CHF	1'000.00	31.03.2017	29.03.2019	36 044 165	CHF	1127.030	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on AXA	EUR	1'000.00	31.03.2017	29.03.2019	36 044 166	CHF	1280.010	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Eni N	EUR	1'000.00	31.03.2017	29.03.2019	36 044 163	CHF	1167.890	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Total	EUR	1'000.00	31.03.2017	29.03.2019	36 044 164	CHF	1227.450	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	31.03.2017	29.03.2019	36 044 162	CHF	967.130	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on The Swatch Grp I	CHF	1'000.00	31.03.2017	29.03.2019	36 044 180	CHF	1130.110	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	31.03.2017	29.03.2019	36 044 178	CHF	983.600	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	31.03.2017	29.03.2019	36 044 168	%	102.320	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	31.03.2017	29.03.2019	36 044 179	CHF	1110.430	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	03.04.2017	03.04.2019	36 044 189	CHF	1245.680	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on The Swatch Grp I	CHF	1'000.00	03.04.2017	03.04.2019	36 044 192	CHF	1129.210	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 5.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.511%	USD	1'000.00	04.04.2017	04.04.2019	36 044 092		-	96.840	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	04.04.2017	04.04.2019	36 044 205	CHF	1132.880	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	04.04.2017	04.04.2019	36 044 206	CHF	1029.850	96.850	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	04.10.2017	04.04.2019	37 823 794	CHF	989.500	97.600	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	04.10.2017	04.04.2019	37 823 808	CHF	984.900	97.600	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Gold 1 Uz PM Fix	USD	1'000.00	05.04.2016	05.04.2019	31 562 245	CHF	1021.240	96.830	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Gold 1 Uz PM Fix	USD	1'000.00	05.04.2016	05.04.2019	31 562 244	CHF	1022.220	96.830	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	05.04.2017	05.04.2019	36 044 237	CHF	1292.290	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CS Group N	CHF	1'000.00	05.04.2017	05.04.2019	36 044 219	CHF	1218.410	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on AXA	EUR	1'000.00	05.04.2017	05.04.2019	36 044 218	CHF	1274.580	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	05.10.2017	05.04.2019	37 823 861	CHF	949.580	97.580	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	05.10.2017	05.04.2019	37 823 856	CHF	1046.180	97.560	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	05.10.2017	05.04.2019	37 823 859	CHF	945.660	97.560	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	05.10.2017	05.04.2019	37 823 848	CHF	912.140	97.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 6.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.681%	USD	1'000.00	06.04.2016	08.04.2019	30 485 447		-	97.120	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Gold 1 Uz PM Fix	USD	1'000.00	08.04.2016	08.04.2019	31 562 252	CHF	1039.760	96.740	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.04.2017	08.04.2019	36 044 254	CHF	973.070	96.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.04.2017	08.04.2019	36 044 255	CHF	1030.050	96.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.04.2017	08.04.2019	36 044 256	CHF	1171.190	96.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.04.2017	08.04.2019	36 044 258	CHF	1057.890	96.860	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.04.2017	08.04.2019	36 044 253	CHF	1059.900	96.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	06.04.2017	08.04.2019	36 044 260	CHF	1044.630	96.790	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.04.2017	08.04.2019	36 044 257	CHF	784.020	96.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.04.2017	08.04.2019	36 044 271	CHF	1176.970	96.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.04.2017	08.04.2019	36 044 274	CHF	564.070	96.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.04.2017	08.04.2019	36 044 272	CHF	1053.130	96.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	09.10.2017	09.04.2019	37 823 874	CHF	1024.830	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	09.10.2017	09.04.2019	37 823 875	CHF	939.340	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.04.2017	10.04.2019	36 044 280	CHF	1013.010	96.830	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	10.04.2017	10.04.2019	36 044 282	CHF	1049.550	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	10.04.2017	10.04.2019	36 044 285	CHF	989.880	96.830	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.04.2017	10.04.2019	36 044 291	CHF	1051.380	96.830	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.04.2017	10.04.2019	36 044 292	CHF	774.610	96.830	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.04.2017	10.04.2019	36 044 290	CHF	1165.710	96.830	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.04.2017	10.04.2019	36 044 296	CHF	1136.440	96.830	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.04.2017	10.04.2019	36 044 289	CHF	1014.500	96.830	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	12.04.2017	12.04.2019	36 044 319	CHF	1081.980	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Blackrock	USD	1'000.00	12.04.2017	12.04.2019	36 044 328	CHF	1278.120	96.900	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	12.04.2017	12.04.2019	36 044 316	CHF	985.020	96.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ING Group Rg	EUR	1'000.00	12.10.2017	12.04.2019	38 486 602	CHF	1116.450	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	12.10.2017	12.04.2019	38 486 566	%	99.400	97.530	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	12.10.2017	12.04.2019	38 486 568	CHF	937.370	97.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.04.2016	15.04.2019	30 485 475	%	46.300	97.200	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	13.04.2017	15.04.2019	36 044 344	CHF	1146.270	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.04.2017	15.04.2019	36 044 348	CHF	1044.230	96.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.04.2017	15.04.2019	36 044 352	CHF	1164.400	96.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	13.04.2017	15.04.2019	36 044 346	CHF	1224.520	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	13.04.2017	15.04.2019	36 044 343	CHF	1137.710	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	13.04.2017	15.04.2019	36 044 349	CHF	1323.030	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.04.2017	15.04.2019	36 044 345	CHF	1169.610	96.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Blackrock	USD	1'000.00	13.04.2017	15.04.2019	36 044 347	CHF	1288.890	96.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.10.2017	15.04.2019	38 486 605	CHF	975.020	97.520	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.10.2017	15.04.2019	38 486 603	CHF	882.620	97.530	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.10.2017	15.04.2019	38 486 604	CHF	975.380	97.530	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ConocoPhillips Rg	USD	1'000.00	13.10.2017	15.04.2019	38 486 601	CHF	1063.210	97.530	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Schlumberger Rg	USD	1'000.00	13.10.2017	15.04.2019	38 486 598	CHF	930.330	97.530	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	18.04.2017	18.04.2019	36 044 330	CHF	996.800	96.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	18.04.2017	18.04.2019	36 044 400	CHF	1264.050	96.920	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	18.04.2017	18.04.2019	36 044 398	CHF	954.610	96.920	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	18.04.2017	18.04.2019	36 044 321	CHF	1032.960	96.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	18.04.2017	18.04.2019	36 044 322	CHF	1039.260	96.900	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Daimler N	EUR	1'000.00	18.04.2017	18.04.2019	36 044 355	CHF	1207.940	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	18.04.2017	18.04.2019	36 044 327	CHF	1002.480	96.900	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	18.04.2017	18.04.2019	36 044 326	CHF	774.060	96.900	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	18.04.2017	18.04.2019	36 044 324	CHF	1054.830	96.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ArcelorMittal Reg	EUR	1'000.00	18.04.2017	18.04.2019	36 044 354	%	102.390	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	18.10.2017	18.04.2019	38 486 667	CHF	763.040	97.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 21.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.682%	USD	1'000.00	21.04.2016	22.04.2019	30 485 487		-	97.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 23.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.837%	USD	1'000.00	21.04.2017	22.04.2019	36 044 439		-	96.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 20.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.914%	GBP	1'000.00	20.10.2015	23.04.2019	28 884 178		-	95.880	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on AXA	EUR	1'000.00	19.04.2017	23.04.2019	36 044 380	CHF	1259.680	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.04.2017	23.04.2019	36 044 350	CHF	1281.430	97.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	19.04.2017	23.04.2019	36 044 386	CHF	1078.330	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on UBS Group N	CHF	1'000.00	20.04.2017	23.04.2019	36 044 396	CHF	1156.780	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on The Swatch Grp I	CHF	1'000.00	20.04.2017	23.04.2019	36 044 395	CHF	1093.070	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Engie	EUR	1'000.00	20.04.2017	23.04.2019	36 044 394	CHF	1293.020	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	20.04.2017	23.04.2019	36 044 403	CHF	1231.130	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	20.04.2017	23.04.2019	36 044 443	CHF	1214.150	96.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	21.04.2017	23.04.2019	36 044 426	CHF	940.220	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	21.04.2017	23.04.2019	36 044 423	CHF	1044.210	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	21.04.2017	23.04.2019	36 044 415	CHF	1030.950	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	23.10.2017	23.04.2019	38 486 708	CHF	1024.290	97.500	100.000		0.000	Y
ProNote with Participation on S&P 500	USD	1'000.00	24.04.2014	24.04.2019	23 996 190	%	130.200	87.149	95.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 31.12.2017 CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 24.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.539%	USD	1'000.00	24.04.2017	24.04.2019	36 044 374		-	96.880	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.10.2017	24.04.2019	38 486 732	CHF	1025.630	97.500	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.10.2017	24.04.2019	38 486 712	CHF	927.770	97.500	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.10.2017	24.04.2019	38 486 729	CHF	913.000	97.500	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	25.04.2017	25.04.2019	36 044 453		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.837%	USD	1'000.00	25.04.2017	25.04.2019	36 044 449		-	96.980	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	25.04.2017	25.04.2019	36 044 448	CHF	945.240	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 25.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	25.04.2017	25.04.2019	36 044 454		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	25.04.2017	25.04.2019	36 044 401	CHF	1091.180	96.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	25.04.2017	25.04.2019	36 044 450		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.10.2017	25.04.2019	38 486 754	%	95.320	97.450	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	26.04.2017	26.04.2019	36 044 456	CHF	1233.380	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.04.2017	26.04.2019	36 044 475	%	98.820	96.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.909%	USD	1'000.00	26.04.2017	26.04.2019	36 044 474		-	97.080	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.04.2017	26.04.2019	36 044 473	%	97.990	97.080	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	26.04.2017	26.04.2019	36 044 472		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.909%	USD	1'000.00	26.04.2017	26.04.2019	36 453 848		-	97.080	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	26.10.2017	26.04.2019	38 486 785	CHF	936.180	97.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.696%	USD	1'000.00	27.04.2017	29.04.2019	36 453 868		-	97.080	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.04.2017	29.04.2019	36 453 854	%	99.190	97.050	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	27.04.2017	29.04.2019	36 453 867	CHF	1197.880	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.673%	USD	1'000.00	27.04.2017	29.04.2019	36 453 870		-	97.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.673%	USD	1'000.00	27.04.2017	29.04.2019	36 453 869		-	97.050	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	28.04.2017	29.04.2019	36 453 878	CHF	1267.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	27.10.2017	29.04.2019	38 486 797	CHF	940.070	97.470	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Apple Rg	USD	1'000.00	01.05.2017	01.05.2019	36 453 889	CHF	1139.520	97.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	01.11.2017	01.05.2019	38 486 846	CHF	855.730	97.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	01.11.2017	01.05.2019	38 486 847	CHF	855.900	97.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	01.11.2017	01.05.2019	38 486 848	CHF	851.550	97.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	02.05.2017	02.05.2019	36 453 887	CHF	1235.590	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.05.2017	02.05.2019	36 453 902	CHF	1217.320	97.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	03.05.2017	03.05.2019	36 453 893	CHF	1030.300	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.551%	USD	1'000.00	03.05.2017	03.05.2019	36 453 918		-	96.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.574%	USD	1'000.00	03.05.2017	03.05.2019	36 453 919		-	96.920	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	04.05.2017	06.05.2019	36 453 909	CHF	1043.850	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Verizon Comm Rg	USD	1'000.00	04.05.2017	06.05.2019	36 453 930	CHF	1073.130	96.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.05.2017	06.05.2019	36 453 931	%	93.450	96.870	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Vale Sp ADR	USD	1'000.00	05.05.2017	06.05.2019	36 453 944	CHF	1356.160	96.920	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	05.05.2017	06.05.2019	36 453 923	CHF	1201.220	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	05.05.2017	06.05.2019	36 453 934	CHF	955.920	96.870	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Vale Sp ADR	USD	1'000.00	05.05.2017	06.05.2019	36 453 943	CHF	1356.630	96.870	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.11.2017	07.05.2019	38 486 898	CHF	926.200	97.470	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Credit Agricole	EUR	1'000.00	08.05.2017	08.05.2019	36 453 935	CHF	1223.680	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	09.05.2017	09.05.2019	36 453 948	CHF	1013.320	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	09.11.2017	09.05.2019	38 486 922	CHF	916.000	97.450	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	10.11.2016	10.05.2019	33 162 806	CHF	1191.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on The Swatch Grp I	CHF	1'000.00	10.05.2017	10.05.2019	36 453 961	CHF	989.200	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 10.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	10.05.2017	10.05.2019	36 453 972		-	96.920	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CS Group N	CHF	1'000.00	10.05.2017	10.05.2019	36 453 960	CHF	1198.850	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Credit Agricole	EUR	1'000.00	10.05.2017	10.05.2019	36 453 963	CHF	1176.070	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Apple Rg	USD	1'000.00	10.11.2017	10.05.2019	37 357 525	CHF	959.850	97.450	100.000		0.000	Y
Protection Participation on FTSE 100	USD	1'000.00	13.05.2015	13.05.2019	25 232 791	%	104.600	84.960	90.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	CHF	1'000.00	12.05.2016	13.05.2019	31 883 761	CHF	1246.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.05.2017	13.05.2019	36 453 990	CHF	1140.430	96.870	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Tesla Rg	USD	1'000.00	12.05.2017	13.05.2019	36 454 014	CHF	1041.550	96.870	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Tesla Rg	USD	1'000.00	12.05.2017	13.05.2019	36 454 007	CHF	1041.390	96.870	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Credit Agricole	EUR	1'000.00	15.05.2017	15.05.2019	36 454 019	CHF	1160.370	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	15.05.2017	15.05.2019	36 454 022	CHF	928.990	96.850	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on The Kraft Heinz Rg	USD	1'000.00	15.05.2017	15.05.2019	36 454 029	CHF	836.860	96.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.05.2017	15.05.2019	36 454 027	%	99.740	96.850	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	15.05.2017	15.05.2019	36 454 028	CHF	1057.820	96.850	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	15.05.2017	15.05.2019	36 454 025	CHF	1072.500	96.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.05.2017	16.05.2019	36 454 041	%	98.870	96.840	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Credit Agricole	EUR	1'000.00	16.05.2017	16.05.2019	36 454 038	CHF	1158.020	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Daimler N	EUR	1'000.00	16.05.2017	16.05.2019	36 454 036	CHF	1181.180	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Credit Agricole	EUR	1'000.00	16.05.2017	16.05.2019	36 454 034	CHF	1146.810	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Bayer N	EUR	1'000.00	16.05.2017	16.05.2019	36 454 035	CHF	1051.630	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.11.2017	16.05.2019	38 486 975	%	100.690	97.420	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.05.2017	17.05.2019	36 454 047	CHF	982.750	96.850	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	17.05.2017	17.05.2019	36 454 049	CHF	1309.170	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	17.05.2017	17.05.2019	36 454 052	CHF	1100.760	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	17.05.2017	17.05.2019	36 454 055	CHF	1027.930	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.05.2017	17.05.2019	36 454 065	%	101.720	96.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.05.2017	17.05.2019	36 454 053	%	100.870	96.830	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	17.11.2017	17.05.2019	38 486 995	CHF	1013.920	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	17.11.2017	17.05.2019	38 487 001	CHF	961.670	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on S&P 500 22.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.672%	USD	1'000.00	27.05.2016	20.05.2019	31 562 289		-	97.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.05.2017	20.05.2019	36 454 072	%	96.420	96.850	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	18.05.2017	20.05.2019	36 454 070	CHF	992.950	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	18.05.2017	20.05.2019	36 454 068	CHF	1120.030	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	18.05.2017	20.05.2019	36 454 067	CHF	1306.640	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	18.05.2017	20.05.2019	36 454 069	CHF	1107.580	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	18.05.2017	20.05.2019	36 454 075	CHF	1217.620	96.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	19.05.2017	20.05.2019	36 454 079	CHF	1039.500	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	19.05.2017	20.05.2019	36 454 082	CHF	1022.600	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.05.2017	20.05.2019	36 454 092	CHF	980.410	96.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	19.05.2017	20.05.2019	36 454 083	CHF	1021.620	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	19.05.2017	20.05.2019	36 454 080	CHF	1023.460	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	19.05.2017	20.05.2019	36 454 081	CHF	1021.510	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Aegon Rg 21.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	19.05.2017	20.05.2019	36 454 078		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	19.05.2017	20.05.2019	36 454 097	CHF	1075.720	96.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	20.11.2017	20.05.2019	38 487 019	CHF	967.520	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	21.11.2017	21.05.2019	38 487 058	CHF	957.730	97.370	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	22.11.2016	22.05.2019	33 162 819	CHF	1177.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Sanofi	EUR	1'000.00	22.05.2017	22.05.2019	36 454 101	CHF	897.060	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	22.05.2017	22.05.2019	36 454 106	CHF	1127.840	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Total	EUR	1'000.00	22.05.2017	22.05.2019	36 454 100	CHF	1157.580	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 22.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.834%	USD	1'000.00	22.05.2017	22.05.2019	36 454 104		-	96.970	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	22.05.2017	22.05.2019	36 454 103	CHF	963.620	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	22.05.2017	22.05.2019	36 454 102	CHF	943.770	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	22.05.2017	22.05.2019	36 454 099	CHF	1121.790	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Sanofi	EUR	1'000.00	22.05.2017	22.05.2019	36 454 105	CHF	926.220	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.05.2017	23.05.2019	36 454 115	%	97.450	97.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.05.2017	23.05.2019	36 454 123	%	84.310	97.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.86%	USD	1'000.00	23.05.2017	23.05.2019	36 454 124		-	97.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	23.11.2017	23.05.2019	38 487 089	CHF	1021.680	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	23.11.2017	23.05.2019	38 487 080	CHF	1194.450	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.05.2017	24.05.2019	36 454 137	CHF	899.330	97.010	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.05.2017	24.05.2019	36 454 143	CHF	1113.560	97.010	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.05.2017	24.05.2019	36 454 142	CHF	847.020	97.010	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.05.2017	24.05.2019	36 454 141	CHF	969.210	97.010	100.000		0.000	Y
3.6 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	26.05.2016	27.05.2019	31 883 776	%	103.200	100.000	100.000		0.000	N
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	27.11.2017	27.05.2019	38 487 108	CHF	1158.060	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 27.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.196%	USD	1'000.00	25.11.2015	28.05.2019	28 884 285		-	95.390	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	25.05.2017	28.05.2019	36 454 156	CHF	1023.950	97.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.05.2017	28.05.2019	36 454 163	%	102.190	97.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.05.2017	28.05.2019	36 454 158	%	101.600	97.010	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on General Electric Rg	USD	1'000.00	25.05.2017	28.05.2019	36 454 151	CHF	609.420	97.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.915%	USD	1'000.00	26.05.2017	28.05.2019	36 454 168		-	97.080	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	26.05.2017	28.05.2019	36 454 155	CHF	1026.140	97.010	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.11.2017	28.05.2019	38 487 104	CHF	950.040	97.340	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	29.11.2017	29.05.2019	38 487 112	CHF	929.630	97.320	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	29.11.2017	29.05.2019	38 486 911	CHF	940.360	97.300	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Orange	EUR	1'000.00	31.05.2017	31.05.2019	36 454 204	CHF	1097.920	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	31.05.2017	31.05.2019	36 454 181	CHF	1181.050	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on BNP Paribas-A-	EUR	1'000.00	31.05.2017	31.05.2019	36 454 203	CHF	1149.220	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nokia Rg	EUR	1'000.00	31.05.2017	31.05.2019	36 454 208	CHF	761.770	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	CHF	1'000.00	03.06.2016	03.06.2019	32 219 267	CHF	1201.210	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	CHF	1'000.00	03.06.2016	03.06.2019	32 219 269	CHF	1186.670	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	01.12.2016	03.06.2019	33 162 843	CHF	1158.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	02.06.2017	03.06.2019	36 454 210	CHF	944.430	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.12.2017	03.06.2019	38 487 150	%	99.410	97.290	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Daimler N	EUR	1'000.00	06.06.2017	06.06.2019	36 454 222	CHF	1234.850	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	06.06.2017	06.06.2019	36 454 223	CHF	1319.340	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	06.06.2017	06.06.2019	36 454 216	CHF	949.270	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.06.2017	07.06.2019	36 454 241	CHF	801.580	97.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	09.03.2017	10.06.2019	34 906 850	CHF	1078.820	96.300	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on AXA	EUR	1'000.00	08.06.2017	10.06.2019	36 454 268	CHF	1206.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Orange	EUR	1'000.00	08.06.2017	10.06.2019	36 454 264	CHF	1100.470	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	09.06.2017	10.06.2019	36 454 279	CHF	1110.460	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	09.06.2017	10.06.2019	36 454 280	CHF	1167.250	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	09.06.2017	10.06.2019	36 454 284	CHF	1164.170	97.010	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	09.06.2017	10.06.2019	36 454 276	CHF	684.300	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	09.06.2017	10.06.2019	36 454 286	CHF	1184.040	97.010	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities 8.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.12.2016	11.06.2019	34 468 395		-	100.000	100.000	08.03. 08.06. 08.09. 08.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker on The Swatch Grp I	CHF	1'000.00	08.06.2017	11.06.2019	36 454 249	CHF	1037.280	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	08.06.2017	11.06.2019	36 454 247	CHF	905.520	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	1'000.00	08.06.2017	11.06.2019	36 454 250	CHF	991.960	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CieFinRichemont N	CHF	1'000.00	08.06.2017	11.06.2019	36 454 253	CHF	1085.420	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur Gr N	CHF	1'000.00	08.06.2017	11.06.2019	36 454 246	CHF	1015.830	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	08.06.2017	11.06.2019	36 454 238	CHF	1205.910	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 12.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.296%	USD	1'000.00	12.06.2015	12.06.2019	25 232 946		-	94.480	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	12.12.2017	12.06.2019	38 487 211	CHF	1009.960	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.06.2017	13.06.2019	36 454 297	CHF	1152.930	97.070	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	14.06.2017	14.06.2019	36 454 302	CHF	928.420	97.070	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	USD	1'000.00	14.06.2017	14.06.2019	36 454 308	CHF	943.440	97.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.06.2017	14.06.2019	36 454 311	%	96.540	97.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.873%	USD	1'000.00	14.06.2017	14.06.2019	36 454 309		-	97.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.895%	USD	1'000.00	14.06.2017	14.06.2019	36 454 304		-	97.060	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	16.12.2016	17.06.2019	34 468 405	CHF	1176.000	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Roche Hldg G	USD	1'000.00	15.06.2017	17.06.2019	36 454 312	CHF	945.610	97.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 15.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	15.06.2017	17.06.2019	35 991 562		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	15.06.2017	17.06.2019	36 454 317	CHF	1202.640	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	16.06.2017	17.06.2019	36 454 332	CHF	1008.580	96.990	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	16.06.2017	17.06.2019	36 454 331	CHF	1043.080	97.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.12.2017	17.06.2019	38 487 253	%	100.800	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	18.12.2017	18.06.2019	38 487 259	CHF	948.430	97.190	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Eli Lilly & Co Rg	USD	1'000.00	19.06.2017	19.06.2019	36 454 339	CHF	1009.670	96.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	19.06.2017	19.06.2019	36 454 342	CHF	1196.110	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Daimler N	EUR	1'000.00	19.06.2017	19.06.2019	36 454 340	CHF	1229.110	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.12.2017	19.06.2019	38 487 269	%	97.700	97.130	100.000		0.000	Y
4.4 % Credit Linked Notes Credit Linked on Bombardier	USD	1'000.00	11.06.2014	20.06.2019	24 334 955	%	99.070	100.000	100.000	20.06. 20.12.	21.470 21.663	N
Underlying Tracker on General Electric Rg	USD	1'000.00	20.06.2017	20.06.2019	36 454 352	CHF	572.670	96.970	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Rio Tinto Sp ADR	USD	1'000.00	21.06.2017	21.06.2019	36 454 367	CHF	1225.820	96.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	21.06.2017	21.06.2019	36 454 364	CHF	1085.650	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	21.06.2017	21.06.2019	36 454 371	CHF	1000.140	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	21.06.2017	21.06.2019	36 454 368	CHF	1127.840	96.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Porsche A Hldg Vz I	EUR	1'000.00	21.12.2017	21.06.2019	38 487 286	CHF	1144.720	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 22.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.684%	USD	1'000.00	22.06.2017	24.06.2019	36 454 375		-	97.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.06.2017	24.06.2019	36 454 376	%	105.020	97.060	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on iShs MSCI Em Mk	USD	1'000.00	22.06.2017	24.06.2019	36 454 382	CHF	1101.970	96.970	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	23.06.2017	24.06.2019	36 454 389	CHF	1093.350	97.010	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	23.06.2017	24.06.2019	36 454 388	CHF	961.740	97.010	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	23.06.2017	24.06.2019	36 454 390	CHF	770.360	97.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.06.2017	26.06.2019	36 454 396	%	73.780	97.010	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	26.06.2017	26.06.2019	36 454 394	CHF	1127.990	97.010	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	29.06.2015	28.06.2019	28 012 830	%	101.500	94.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.598%	USD	1'000.00	28.06.2017	28.06.2019	36 454 436		-	96.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.902%	USD	1'000.00	28.06.2017	28.06.2019	36 454 372		-	97.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.06.2017	28.06.2019	36 454 429	%	101.130	96.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.06.2017	28.06.2019	36 454 434	%	98.320	96.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.06.2017	28.06.2019	36 454 431	%	98.210	96.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.06.2017	28.06.2019	36 454 430	%	101.340	96.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.06.2017	28.06.2019	36 454 432	%	101.360	96.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Tesla Rg	USD	1'000.00	28.06.2017	28.06.2019	36 454 425	CHF	823.540	96.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Daimler N	EUR	1'000.00	28.06.2017	28.06.2019	36 454 422	CHF	1209.810	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Rio Tinto Sp ADR	USD	1'000.00	28.06.2017	28.06.2019	36 454 421	CHF	1297.930	96.970	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on UBS Group N	CHF	1'000.00	28.06.2017	28.06.2019	36 454 420	CHF	1089.690	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.06.2017	28.06.2019	36 454 419	%	101.730	96.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.06.2017	28.06.2019	36 454 426	%	102.750	96.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.06.2017	28.06.2019	36 454 427	%	87.370	96.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CS Group N	CHF	1'000.00	30.06.2017	28.06.2019	36 454 453	CHF	1269.750	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	30.06.2017	28.06.2019	36 454 456	CHF	1181.670	100.000	100.000		0.000	Y
Outperformance Bonus Certificate on Zurich Insur GrpN	CHF	1'000.00	03.07.2014	03.07.2019	24 409 022	CHF	1353.000	99.100	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	03.07.2017	03.07.2019	36 454 461	CHF	925.000	96.990	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Total	EUR	1'000.00	03.07.2017	03.07.2019	36 454 463	CHF	1224.020	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	05.07.2017	05.07.2019	36 454 470	CHF	1167.500	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	05.07.2017	05.07.2019	36 454 477	CHF	1368.520	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	05.07.2017	05.07.2019	36 454 478	CHF	1368.520	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 10.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.029%	USD	1'000.00	07.07.2015	08.07.2019	25 233 135		-	94.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	06.07.2017	08.07.2019	36 851 987	CHF	1111.640	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	07.07.2017	08.07.2019	36 454 445	%	102.700	96.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	07.07.2017	08.07.2019	36 454 495	CHF	986.790	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	07.07.2017	08.07.2019	36 454 497	CHF	986.080	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Telefonica Br	EUR	1'000.00	07.07.2017	08.07.2019	36 454 499	CHF	1031.790	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	10.07.2017	10.07.2019	36 454 511	CHF	1122.330	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	11.07.2017	11.07.2019	36 454 517	CHF	1070.300	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.07.2017	12.07.2019	36 454 536	%	101.000	96.800	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	12.07.2017	12.07.2019	36 454 532	CHF	1152.900	96.800	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	12.07.2017	12.07.2019	36 454 523	CHF	1023.410	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	12.07.2017	12.07.2019	36 454 525	CHF	1103.590	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	12.07.2017	12.07.2019	36 454 534	CHF	1156.420	96.800	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	12.10.2017	12.07.2019	38 486 597	CHF	881.570	100.000	100.000		0.000	Y
Daily Accrual Notes on basket	USD	1'000.00	14.07.2014	15.07.2019	24 334 973	%	82.700	91.420	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTXBnk EUR P	EUR	1'000.00	14.07.2016	15.07.2019	32 219 420	CHF	1888.620	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	13.07.2017	15.07.2019	36 454 537	CHF	1105.860	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.07.2017	15.07.2019	36 454 544	CHF	1088.980	96.800	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	1'000.00	14.07.2017	15.07.2019	36 454 551	CHF	1039.090	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.10.2017	15.07.2019	38 486 596	CHF	764.510	97.080	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on SMI	CHF	1'000.00	17.07.2014	17.07.2019	24 409 062	CHF	1106.770	98.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.07.2017	17.07.2019	36 454 560	%	100.700	96.800	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.07.2017	17.07.2019	36 454 559	CHF	1131.850	96.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	18.07.2017	18.07.2019	36 454 570	CHF	977.800	96.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.024%	USD	1'000.00	18.07.2017	18.07.2019	36 454 574		-	96.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.07.2017	18.07.2019	36 454 575	%	94.210	96.790	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	18.07.2017	18.07.2019	36 454 571	CHF	978.630	96.800	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	18.07.2017	18.07.2019	36 454 578	CHF	978.480	96.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.024%	USD	1'000.00	18.07.2017	18.07.2019	36 454 576		-	96.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.024%	USD	1'000.00	18.07.2017	18.07.2019	36 454 573		-	96.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 19.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.01.2017	19.07.2019	34 906 188		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.07.2017	19.07.2019	36 454 588	CHF	1061.710	96.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.07.2017	19.07.2019	36 454 595	%	99.800	96.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	19.07.2017	19.07.2019	36 454 587	%	101.700	96.880	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Orange	EUR	1'000.00	19.07.2017	19.07.2019	36 454 584	CHF	1212.450	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.07.2017	22.07.2019	36 454 602	%	82.080	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Tesla Rg	USD	1'000.00	20.07.2017	22.07.2019	36 454 615	%	98.610	96.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.07.2017	22.07.2019	36 454 609	%	95.100	96.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	20.07.2017	22.07.2019	36 454 603	CHF	1096.540	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.07.2017	22.07.2019	36 454 596	%	82.180	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.07.2017	22.07.2019	36 454 611	%	101.470	96.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.07.2017	22.07.2019	36 454 610	%	101.490	96.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	20.07.2017	22.07.2019	36 454 598	CHF	970.660	96.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.07.2017	22.07.2019	36 454 605	%	99.600	96.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	21.07.2017	22.07.2019	36 454 626	CHF	1074.570	96.890	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	21.07.2017	22.07.2019	36 852 017	%	96.800	100.000	100.000	23.10.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	24.01.2017	24.07.2019	34 468 461	CHF	1139.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.07.2017	24.07.2019	36 454 633	CHF	937.050	96.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	25.07.2017	25.07.2019	36 454 569	%	100.000	96.840	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	25.07.2017	25.07.2019	36 454 647	CHF	947.470	96.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	25.07.2017	25.07.2019	36 454 648	CHF	1082.380	96.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	25.07.2017	25.07.2019	36 454 638	CHF	993.930	96.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	25.07.2017	25.07.2019	36 454 645	CHF	1043.620	96.890	100.000		0.000	Y
Barrier Reverse Convertible on FTSE 100-Index	GBP	1.00	31.07.2013	26.07.2019	21 496 855	%	105.210	90.940	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	26.07.2017	26.07.2019	36 454 660	CHF	921.270	96.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Tesla Rg	USD	1'000.00	26.07.2017	26.07.2019	36 454 659	CHF	925.730	96.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	27.07.2017	29.07.2019	36 454 674	CHF	966.570	96.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	27.07.2017	29.07.2019	36 454 669	CHF	933.210	96.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.07.2017	29.07.2019	36 454 520	CHF	995.910	96.880	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.07.2017	29.07.2019	36 454 521	CHF	994.930	96.880	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on FTSE MIB	EUR	1'000.00	30.07.2014	30.07.2019	24 409 144	CHF	1265.450	96.810	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	31.07.2017	31.07.2019	36 454 683	CHF	1109.510	96.880	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	01.08.2014	01.08.2019	24 409 157	CHF	1314.650	96.760	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	01.08.2016	01.08.2019	32 219 462	CHF	1354.600	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	01.02.2017	01.08.2019	34 906 343	CHF	1265.610	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.08.2017	01.08.2019	36 454 675	%	101.430	96.890	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 1.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.071%	USD	1'000.00	01.08.2017	01.08.2019	36 454 698		-	96.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.071%	USD	1'000.00	01.08.2017	01.08.2019	36 454 697		-	96.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.08.2017	01.08.2019	36 454 696	%	96.400	96.840	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	01.08.2017	01.08.2019	36 454 689	CHF	1163.570	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.117%	USD	1'000.00	01.08.2017	01.08.2019	36 454 688		-	96.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	01.08.2017	01.08.2019	36 454 687		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	01.11.2017	01.08.2019	38 486 833	CHF	840.430	96.990	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.08.2017	02.08.2019	36 454 713	CHF	971.950	96.840	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	02.08.2017	02.08.2019	36 454 718	CHF	1165.850	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.08.2017	02.08.2019	36 454 721	CHF	1118.890	96.840	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.08.2017	02.08.2019	36 454 724	CHF	908.060	96.840	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.08.2017	02.08.2019	36 454 720	CHF	1097.380	96.840	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	03.02.2017	05.08.2019	34 906 375	CHF	1268.150	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	03.02.2017	05.08.2019	34 468 481	CHF	1194.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	03.08.2017	05.08.2019	36 454 730	CHF	1165.500	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	03.08.2017	05.08.2019	36 454 704	CHF	1071.410	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	04.08.2017	05.08.2019	36 852 050	CHF	1161.370	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Zurich Insur Gr N	CHF	1'000.00	04.08.2017	05.08.2019	36 603 407	%	99.400	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	07.08.2017	07.08.2019	36 454 745	CHF	1075.990	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.08.2017	07.08.2019	36 454 749	%	96.440	96.870	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	07.08.2017	07.08.2019	36 454 736	CHF	1074.360	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.071%	USD	1'000.00	08.08.2017	08.08.2019	36 454 723		-	96.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.071% 8.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	08.08.2017	08.08.2019	36 454 699		-	96.840	100.000	08.11.	0.000	Y
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	77.71	09.08.2016	09.08.2019	32 219 476	CHF	84.010	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.08.2017	09.08.2019	36 454 773	%	94.300	96.880	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	09.08.2017	09.08.2019	36 454 765	CHF	1117.330	96.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	09.08.2017	09.08.2019	36 454 768	CHF	1078.570	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	09.08.2017	09.08.2019	36 454 763	CHF	1090.190	96.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	09.08.2017	09.08.2019	36 454 760	CHF	1100.880	96.890	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on SMI	CHF	1'000.00	11.08.2014	12.08.2019	24 409 178	CHF	1166.560	98.590	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	10.08.2017	12.08.2019	36 454 774	%	101.290	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.08.2017	12.08.2019	36 454 778	CHF	929.880	96.880	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	11.08.2017	12.08.2019	36 454 786	CHF	1069.700	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	14.08.2017	14.08.2019	36 454 795	CHF	1214.790	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	14.08.2017	14.08.2019	36 454 794	CHF	1147.430	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	14.08.2017	14.08.2019	36 454 796	CHF	1065.050	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	15.08.2017	15.08.2019	36 454 804	CHF	1053.600	96.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	15.08.2017	15.08.2019	36 454 800	CHF	1062.680	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	15.08.2017	15.08.2019	36 454 805	CHF	1071.170	96.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	15.08.2017	15.08.2019	36 454 806	CHF	1057.920	96.860	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.08.2016	16.08.2019	31 883 924	%	99.360	100.000	100.000	16.02. 16.08.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	16.08.2017	16.08.2019	36 454 816	CHF	1114.810	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	16.08.2017	16.08.2019	36 454 799	CHF	1240.790	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on UBS Group N	CHF	1'000.00	16.08.2017	16.08.2019	36 454 810	CHF	1028.940	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	17.02.2017	19.08.2019	34 468 499	CHF	1104.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	17.08.2017	19.08.2019	36 454 822	CHF	1111.880	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	17.08.2017	19.08.2019	36 454 823	CHF	1127.100	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	17.08.2017	19.08.2019	36 454 828	%	99.790	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	18.08.2017	19.08.2019	36 454 834	CHF	1127.820	96.890	100.000		0.000	Y
Barrier Reverse Convertible on S&P 500-Index	USD	1.00	20.08.2013	20.08.2019	21 496 868	%	104.360	88.740	100.000		0.000	Y
3.6 % Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	20.08.2015	20.08.2019	24 874 892	%	102.010	100.000	100.000	20.02. 22.05. 20.08. 20.11.	0.71847 0.73855 0.76605 0.78593	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4.9 % Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	20.08.2015	20.08.2019	24 874 891	%	99.990	100.000	100.000	21.02. 20.05. 20.08. 20.11.	3.735 3.599 3.553 3.666	N
2.7 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	20.08.2015	20.08.2019	24 874 893	%	100.640	100.000	100.000	21.02. 22.05. 21.08. 20.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	21.08.2017	21.08.2019	36 454 841	CHF	1108.490	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	21.08.2017	21.08.2019	36 454 842	CHF	995.450	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	21.08.2017	21.08.2019	36 454 844	CHF	1209.420	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.08.2017	22.08.2019	36 454 821	%	92.250	96.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	23.08.2017	23.08.2019	37 823 392	CHF	869.950	96.880	100.000		0.000	Y
ProNote with Capped Participation on Equities	CHF	1'000.00	26.08.2014	26.08.2019	24 903 170	%	102.470	98.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 24.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.116%	USD	1'000.00	24.08.2017	26.08.2019	36 454 824		-	96.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	25.08.2017	26.08.2019	37 823 417	CHF	1155.990	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	25.08.2017	26.08.2019	37 823 418	CHF	847.530	96.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 30.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.173%	USD	1'000.00	27.08.2015	27.08.2019	28 883 947		-	94.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 30.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.333%	GBP	1'000.00	27.08.2015	27.08.2019	28 883 948		-	94.180	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Total	EUR	1'000.00	29.08.2017	29.08.2019	37 823 431	CHF	1235.450	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	29.08.2017	29.08.2019	37 823 427	CHF	1169.050	100.000	100.000		0.000	Y
5.1 % Reverse Convertible on Equities 31.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	31.08.2016	30.08.2019	33 162 680		-	100.000	100.000	28.02. 31.08.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Sanofi	EUR	1'000.00	30.08.2017	30.08.2019	37 823 432	CHF	969.200	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	30.08.2017	30.08.2019	37 823 433	CHF	1091.850	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Rio Tinto Sp ADR	USD	1'000.00	30.08.2017	30.08.2019	37 823 441	CHF	1070.160	96.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Rio Tinto Sp ADR	USD	1'000.00	30.08.2017	30.08.2019	37 823 440	CHF	1068.730	96.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	30.08.2017	30.08.2019	37 823 436	CHF	905.450	96.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	30.08.2017	30.08.2019	37 823 434	CHF	958.750	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	31.08.2017	30.08.2019	37 823 445	CHF	1119.660	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	31.08.2017	30.08.2019	37 823 459	CHF	912.110	96.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	31.08.2017	30.08.2019	37 823 466	CHF	1034.500	96.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Generali N	EUR	1'000.00	31.08.2017	30.08.2019	37 823 449	CHF	1121.460	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	31.08.2017	30.08.2019	37 823 448	CHF	1078.760	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	31.08.2017	30.08.2019	37 823 465	CHF	1036.290	96.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	01.09.2017	02.09.2019	37 823 473	CHF	1081.930	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	01.09.2017	02.09.2019	37 823 474	CHF	1081.410	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Las Vegas Sands Rg	USD	1'000.00	01.09.2017	03.09.2019	37 823 478	CHF	1095.920	96.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	01.09.2017	03.09.2019	37 823 470	CHF	959.970	96.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.09.2017	03.09.2019	37 823 480	%	97.100	96.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	05.09.2017	05.09.2019	37 823 489	CHF	1009.680	96.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	05.09.2017	05.09.2019	37 823 490	CHF	1100.300	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	05.09.2017	05.09.2019	37 823 492	CHF	1284.680	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	05.09.2017	05.09.2019	37 823 491	CHF	1110.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	06.09.2017	06.09.2019	37 823 510	CHF	976.890	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 8.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.333%	USD	1'000.00	08.09.2015	09.09.2019	28 884 008		-	94.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 8.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.333%	USD	1'000.00	08.09.2015	09.09.2019	28 884 009		-	94.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	09.09.2016	09.09.2019	33 162 694	CHF	1113.000	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	07.03.2017	09.09.2019	34 906 819	%	100.160	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	08.03.2017	09.09.2019	34 468 553	CHF	1103.000	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.09.2017	09.09.2019	37 823 502	%	98.860	97.030	100.000		0.000	Y
7.25 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.09.2017	09.09.2019	36 852 121	%	97.700	100.000	100.000	07.12.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.09.2017	09.09.2019	37 823 506	CHF	950.740	97.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	08.09.2017	09.09.2019	37 823 534	CHF	1110.330	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	08.09.2017	09.09.2019	37 823 533	CHF	1146.600	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	08.09.2017	09.09.2019	37 823 527	CHF	940.510	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	08.09.2017	09.09.2019	37 823 537	CHF	1220.820	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	08.09.2017	09.09.2019	37 823 539	CHF	1241.960	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.09.2017	11.09.2019	37 823 532	%	99.130	96.990	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.09.2017	11.09.2019	37 823 529	CHF	894.210	96.990	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.09.2017	11.09.2019	37 823 523	%	94.660	96.990	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.09.2017	11.09.2019	37 823 536	CHF	781.300	96.990	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 11.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.131%	USD	1'000.00	11.09.2017	11.09.2019	37 823 471		-	96.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.09.2017	11.09.2019	37 823 542	CHF	1000.190	96.990	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.09.2017	11.09.2019	37 823 541	CHF	921.710	96.990	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.09.2017	11.09.2019	37 823 538	CHF	939.680	96.990	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.09.2017	11.09.2019	37 823 540	CHF	1015.510	96.990	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Swiss Life Hldg N	CHF	1'000.00	12.09.2017	12.09.2019	37 823 555	CHF	981.070	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on The Swatch Grp I	CHF	1'000.00	12.09.2017	12.09.2019	37 823 549	CHF	1033.750	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	12.09.2017	12.09.2019	37 823 557	CHF	1017.760	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Geberit N	CHF	1'000.00	12.09.2017	12.09.2019	37 823 553	CHF	963.350	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.09.2017	13.09.2019	37 823 585	CHF	1053.760	97.010	100.000		0.000	Y
8.15 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.09.2017	13.09.2019	36 852 130	%	99.760	100.000	100.000	13.12.	0.000	N
5.5 % Reverse Convertible on Basket 14.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	14.09.2016	16.09.2019	33 162 711		-	100.000	100.000	14.03. 14.09.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	15.03.2017	16.09.2019	34 468 561	CHF	1100.180	95.690	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	CHF	1'000.00	15.03.2017	16.09.2019	34 468 560	CHF	1093.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	14.09.2017	16.09.2019	37 823 592	CHF	1036.840	97.010	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	1'000.00	15.09.2017	16.09.2019	37 823 601	CHF	1012.640	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on American Intl Gr Rg	USD	1'000.00	15.09.2017	16.09.2019	37 823 604	CHF	974.080	97.070	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	17.03.2017	17.09.2019	34 468 577	CHF	1261.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	17.03.2017	17.09.2019	34 906 967	CHF	1079.550	95.620	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	18.09.2014	18.09.2019	25 273 670	%	108.500	90.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 20.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.09.2016	19.09.2019	32 219 650		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 20.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	19.09.2016	19.09.2019	32 219 655		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on IBEX 35 20.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	19.09.2016	19.09.2019	32 219 652		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.09.2017	19.09.2019	37 823 632	CHF	906.270	96.990	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.09.2017	19.09.2019	37 823 634	CHF	935.370	96.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.09.2017	19.09.2019	37 823 635	CHF	869.390	96.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.09.2017	19.09.2019	37 823 631	CHF	871.010	96.990	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.09.2017	19.09.2019	37 823 628	CHF	937.080	96.990	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	19.09.2017	19.09.2019	37 823 623	CHF	1081.970	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	19.09.2017	19.09.2019	37 823 633	CHF	964.410	96.990	100.000		0.000	Y
1 1/4 % StructuredNote Credit Linked on Metro AG	CHF	1'000.00	17.09.2014	20.09.2019	24 903 175	%	100.830	100.000	100.000	22.03. 20.06. 22.09. 22.12.	3.194 3.125 3.194 3.125	N
5 % Reverse Convertible Called for red. on 20.09.17 at 100% 20.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	20.09.2016	20.09.2019	33 162 716		-	100.000	100.000	20.03. 20.09.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	20.09.2017	20.09.2019	37 823 649	CHF	864.790	96.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	20.09.2017	20.09.2019	37 823 654	CHF	924.140	96.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	20.09.2017	20.09.2019	37 823 650	CHF	933.610	96.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	20.09.2017	20.09.2019	37 823 648	CHF	963.610	96.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	20.09.2017	20.09.2019	37 823 652	CHF	966.160	96.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 21.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.763%	USD	1'000.00	21.09.2016	23.09.2019	32 219 671		-	96.830	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	22.09.2016	23.09.2019	32 219 673	CHF	1367.430	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	22.03.2017	23.09.2019	34 468 588	CHF	1065.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	21.09.2017	23.09.2019	37 823 665	CHF	898.130	96.890	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	21.09.2017	23.09.2019	37 823 661	CHF	1069.060	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	21.09.2017	23.09.2019	37 823 672	CHF	962.720	96.840	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	21.09.2017	23.09.2019	37 823 671	CHF	935.430	96.840	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	21.09.2017	23.09.2019	37 823 668	CHF	971.130	96.840	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	22.09.2017	23.09.2019	37 823 688	CHF	1064.140	96.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	22.09.2017	23.09.2019	37 823 687	CHF	792.980	96.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	22.09.2017	23.09.2019	37 823 686	CHF	965.680	96.840	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	22.09.2017	23.09.2019	37 823 684	CHF	862.060	96.840	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	22.09.2017	23.09.2019	37 823 689	CHF	1073.930	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	22.09.2017	23.09.2019	37 823 682	CHF	864.620	96.840	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	22.09.2017	23.09.2019	37 823 681	CHF	1051.810	96.840	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	22.09.2017	23.09.2019	37 823 683	CHF	968.410	96.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 25.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.12%	USD	1'000.00	24.09.2015	24.09.2019	28 884 106		-	94.640	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Apple Rg	USD	1'000.00	25.09.2017	25.09.2019	37 823 690	CHF	1019.960	96.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.09.2017	26.09.2019	37 823 699	%	100.130	96.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Schlumberger Rg	USD	1'000.00	26.09.2017	26.09.2019	37 823 707	%	97.800	96.760	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	27.09.2017	27.09.2019	37 823 712	CHF	1000.150	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on HS China Ent Index	USD	1'000.00	27.09.2017	27.09.2019	37 823 713	CHF	984.060	96.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.09.2017	27.09.2019	37 823 728	%	97.500	96.700	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 27.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.168%	USD	1'000.00	27.09.2017	27.09.2019	37 823 644		-	96.950	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	27.09.2017	27.09.2019	37 823 721	CHF	1055.250	96.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Credit Agricole	EUR	1'000.00	27.09.2017	27.09.2019	37 823 710	CHF	1042.610	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities 29.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	29.09.2016	30.09.2019	33 162 734		-	100.000	100.000	29.03. 29.09.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	30.03.2017	30.09.2019	35 765 721	CHF	1358.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.09.2017	30.09.2019	37 823 736	CHF	888.340	96.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.09.2017	30.09.2019	37 823 742	CHF	961.360	96.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.09.2017	30.09.2019	37 823 741	CHF	904.530	96.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.09.2017	30.09.2019	37 823 740	CHF	1056.290	96.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.09.2017	30.09.2019	37 823 739	CHF	778.230	96.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.09.2017	30.09.2019	37 823 747	CHF	926.270	96.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.09.2017	30.09.2019	37 823 746	CHF	971.150	96.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.09.2017	30.09.2019	37 823 737	CHF	812.830	96.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.09.2017	30.09.2019	37 823 738	CHF	935.490	96.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.09.2017	30.09.2019	37 823 745	CHF	967.660	96.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Gilead Sciences Rg	USD	1'000.00	28.09.2017	30.09.2019	37 823 766	CHF	826.880	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.09.2017	30.09.2019	37 823 754	CHF	890.170	96.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.09.2017	30.09.2019	37 823 753	CHF	871.920	96.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.09.2017	30.09.2019	37 823 748	CHF	928.970	96.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.09.2017	30.09.2019	37 823 744	CHF	951.560	96.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.09.2017	30.09.2019	37 823 751	CHF	892.510	96.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	28.09.2017	30.09.2019	37 823 750	CHF	941.280	96.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	29.09.2017	30.09.2019	37 823 771	CHF	759.070	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	29.09.2017	30.09.2019	37 823 775	CHF	869.320	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	29.09.2017	30.09.2019	37 823 773	CHF	886.340	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	29.09.2017	30.09.2019	37 823 772	CHF	909.360	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	29.09.2017	30.09.2019	37 823 776	CHF	900.410	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	02.10.2017	02.10.2019	37 823 781	CHF	1071.130	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	02.10.2017	02.10.2019	37 823 784	CHF	1127.130	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	02.10.2017	02.10.2019	37 823 785	%	99.100	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.10.2017	02.10.2019	37 823 788	CHF	934.850	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.10.2017	02.10.2019	37 823 789	CHF	863.430	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.10.2017	02.10.2019	37 823 787	CHF	945.230	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.10.2017	03.10.2019	37 823 798	CHF	1021.240	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.10.2017	03.10.2019	37 823 799	CHF	1093.470	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.10.2017	03.10.2019	37 823 802	CHF	1054.360	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.10.2017	03.10.2019	37 823 807	CHF	1027.720	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.10.2017	03.10.2019	37 823 803	CHF	790.990	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.10.2017	03.10.2019	37 823 809	CHF	1015.470	96.680	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.10.2017	03.10.2019	37 823 805	%	96.760	96.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.10.2017	03.10.2019	37 823 811	%	99.130	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.10.2017	03.10.2019	37 823 810	CHF	1091.450	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.10.2017	03.10.2019	37 823 800	CHF	1012.870	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	03.10.2017	03.10.2019	37 823 806	CHF	1146.520	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.10.2017	03.10.2019	37 823 801	CHF	1089.710	96.680	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.10.2017	04.10.2019	37 823 819	%	98.760	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	04.10.2017	04.10.2019	37 823 818	CHF	1014.960	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	04.10.2017	04.10.2019	37 823 820	CHF	1080.480	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	04.10.2017	04.10.2019	37 823 823	CHF	1060.730	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	04.10.2017	04.10.2019	37 823 840	CHF	1064.390	96.630	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	04.10.2017	04.10.2019	37 823 836	CHF	921.550	96.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	04.10.2017	04.10.2019	37 823 837	CHF	897.500	96.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	04.10.2017	04.10.2019	37 823 838	CHF	881.380	96.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	04.10.2017	04.10.2019	37 823 839	CHF	916.040	96.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	04.10.2017	04.10.2019	37 823 824	CHF	800.680	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	05.10.2017	07.10.2019	37 823 846	CHF	878.080	96.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	05.10.2017	07.10.2019	37 823 844	CHF	914.860	96.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	05.10.2017	07.10.2019	37 823 849	CHF	1056.160	96.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	05.10.2017	07.10.2019	37 823 845	CHF	924.530	96.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	05.10.2017	07.10.2019	37 823 850	CHF	902.100	96.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	05.10.2017	07.10.2019	37 823 851	CHF	962.820	96.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	05.10.2017	07.10.2019	37 823 847	CHF	896.320	96.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	05.10.2017	07.10.2019	37 823 854	CHF	964.450	96.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.10.2017	07.10.2019	37 823 868	CHF	870.070	96.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.10.2017	07.10.2019	37 823 869	CHF	891.310	96.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.10.2017	10.10.2019	37 823 878	CHF	859.420	96.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	10.10.2017	10.10.2019	37 823 880	CHF	1014.870	96.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.10.2017	10.10.2019	37 823 879	CHF	905.650	96.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.10.2017	10.10.2019	37 823 882	CHF	857.910	96.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.10.2017	10.10.2019	37 823 881	CHF	898.380	96.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.10.2017	10.10.2019	37 823 884	CHF	1031.320	96.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.10.2017	10.10.2019	38 486 544	CHF	949.920	96.610	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	10.10.2017	10.10.2019	38 486 545	CHF	1056.980	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.10.2017	10.10.2019	37 823 885	CHF	862.570	96.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.10.2017	10.10.2019	38 486 541	CHF	996.260	96.610	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	10.10.2017	10.10.2019	38 486 546	CHF	951.370	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.10.2017	10.10.2019	38 486 542	CHF	857.340	96.610	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.10.2017	10.10.2019	37 823 883	CHF	883.490	96.630	100.000		0.000	Y
Barrier Reverse Convertible on S&P 500-Index	USD	1.00	11.10.2013	11.10.2019	21 496 866	%	105.740	89.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 11.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.827%	USD	1'000.00	11.04.2017	11.10.2019	36 044 208		-	95.850	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.10.2017	11.10.2019	38 486 551	CHF	881.140	96.610	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.10.2017	11.10.2019	38 486 552	CHF	804.550	96.610	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.10.2017	11.10.2019	38 486 555	CHF	1048.800	96.610	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.10.2017	11.10.2019	38 486 556	CHF	953.070	96.610	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.10.2017	11.10.2019	38 486 550	CHF	930.380	96.610	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.10.2017	11.10.2019	38 486 557	CHF	879.150	96.610	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.10.2017	11.10.2019	38 486 554	CHF	880.360	96.610	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	12.10.2017	14.10.2019	38 064 802	CHF	985.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	12.10.2017	14.10.2019	38 486 613	CHF	1145.130	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	12.10.2017	14.10.2019	38 486 587	CHF	944.840	100.000	100.000		0.000	Y
2.9 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	15.10.2015	15.10.2019	24 874 983	%	102.210	100.000	100.000	16.01. 15.04. 17.07. 15.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Crude Oil Barrel	USD	1'000.00	18.04.2017	15.10.2019	36 044 367	CHF	941.340	95.980	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	12.10.2017	15.10.2019	38 486 572	CHF	893.110	96.610	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	12.10.2017	15.10.2019	38 486 574	CHF	929.570	96.610	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	12.10.2017	15.10.2019	38 486 577	CHF	744.340	96.610	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	12.10.2017	15.10.2019	38 486 579	CHF	1014.000	96.610	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	12.10.2017	15.10.2019	38 486 585	CHF	1044.550	96.590	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	12.10.2017	15.10.2019	38 486 580	CHF	902.020	96.610	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	12.10.2017	15.10.2019	38 486 584	CHF	848.150	96.590	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	12.10.2017	15.10.2019	38 486 582	CHF	926.380	96.610	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	12.10.2017	15.10.2019	38 486 570	CHF	780.670	96.610	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	12.10.2017	15.10.2019	38 486 583	CHF	954.670	96.590	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	12.10.2017	15.10.2019	38 486 581	CHF	821.170	96.610	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.10.2017	15.10.2019	38 486 606	CHF	753.140	96.570	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.10.2017	15.10.2019	38 486 610	CHF	1043.170	96.570	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.10.2017	15.10.2019	38 486 614	CHF	1023.540	96.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.10.2017	15.10.2019	38 486 615	%	101.090	96.570	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.10.2017	15.10.2019	38 486 612	CHF	871.520	96.570	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.10.2017	15.10.2019	38 486 611	CHF	703.450	96.570	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.10.2017	15.10.2019	38 486 594	CHF	959.400	96.590	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.10.2017	15.10.2019	38 486 608	CHF	900.060	96.570	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.10.2017	15.10.2019	38 486 609	CHF	933.120	96.570	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.10.2017	15.10.2019	38 486 607	CHF	894.760	96.570	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur Gr N	CHF	1'000.00	16.10.2017	16.10.2019	38 486 641	CHF	984.230	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	16.10.2017	16.10.2019	38 486 630	CHF	1021.080	96.530	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	16.10.2017	16.10.2019	38 064 807	CHF	1201.740	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	16.10.2017	16.10.2019	38 486 634	CHF	931.470	96.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.10.2017	16.10.2019	38 486 638	%	97.990	96.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.10.2017	16.10.2019	38 486 632	%	96.540	96.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.10.2017	16.10.2019	38 486 633	%	97.670	96.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.10.2017	16.10.2019	38 486 636	%	96.100	96.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.10.2017	16.10.2019	38 486 637	%	95.400	96.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.10.2017	16.10.2019	38 486 635	%	98.030	96.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.10.2017	16.10.2019	38 486 631	%	95.680	96.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.10.2017	16.10.2019	38 486 639	%	96.510	96.530	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.10.2017	17.10.2019	38 486 647	CHF	957.430	96.530	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.10.2017	17.10.2019	38 486 648	CHF	836.960	96.530	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.10.2017	17.10.2019	38 486 657	CHF	1015.550	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.10.2017	17.10.2019	38 486 652	CHF	1007.200	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.10.2017	17.10.2019	38 486 649	CHF	1015.610	96.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 18.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.246%	USD	1'000.00	18.10.2016	18.10.2019	32 219 774		-	96.660	100.000	18.10.	0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	18.10.2017	18.10.2019	38 486 665	CHF	899.140	96.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.10.2017	18.10.2019	38 486 664	%	100.810	96.560	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	18.10.2017	18.10.2019	38 486 662	CHF	999.470	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.10.2017	18.10.2019	38 486 663	%	99.330	96.560	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	19.10.2016	21.10.2019	32 219 812	CHF	1199.080	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	20.04.2017	21.10.2019	36 044 391	CHF	1235.120	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	20.04.2017	21.10.2019	36 044 390	CHF	1235.970	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	21.04.2017	21.10.2019	36 044 420	CHF	1051.060	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.10.2017	21.10.2019	38 486 679	%	97.400	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.10.2017	21.10.2019	38 486 677	CHF	830.190	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.10.2017	21.10.2019	38 486 686	CHF	920.060	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.10.2017	21.10.2019	38 486 676	CHF	940.140	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.10.2017	21.10.2019	38 486 675	CHF	1031.260	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.10.2017	21.10.2019	38 486 674	CHF	947.510	96.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.10.2017	21.10.2019	38 486 673	%	94.850	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	19.10.2017	21.10.2019	38 486 672	CHF	904.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.10.2017	21.10.2019	38 486 687	CHF	899.070	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.10.2017	21.10.2019	38 486 683	CHF	946.920	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.10.2017	21.10.2019	38 486 688	CHF	1014.830	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	19.10.2017	21.10.2019	38 486 678	CHF	1014.190	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.10.2017	21.10.2019	38 486 680	CHF	1018.280	96.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.10.2017	21.10.2019	38 486 681	%	99.290	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.10.2017	21.10.2019	38 486 689	CHF	1052.640	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.10.2017	21.10.2019	38 486 682	CHF	1015.470	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	CHF	1'000.00	20.10.2017	21.10.2019	38 486 693	CHF	970.960	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Deutsche Bank N	EUR	1'000.00	20.10.2017	21.10.2019	38 486 692	%	101.960	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	20.10.2017	21.10.2019	38 064 830	CHF	1059.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	23.10.2017	23.10.2019	38 486 705	CHF	1022.930	96.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	24.10.2017	24.10.2019	38 486 643	%	99.300	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	24.10.2017	24.10.2019	38 486 727	CHF	1062.250	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.10.2017	24.10.2019	38 486 733	CHF	841.860	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.10.2017	24.10.2019	38 486 734	CHF	938.320	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Credit Agricole	EUR	1'000.00	24.10.2017	24.10.2019	38 486 741	CHF	1055.280	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.10.2017	24.10.2019	38 486 737	CHF	1016.930	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	24.10.2017	24.10.2019	38 486 738	CHF	1067.230	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.10.2017	24.10.2019	38 486 739	CHF	896.960	96.480	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.10.2017	24.10.2019	38 486 736	CHF	936.060	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	25.10.2017	25.10.2019	38 486 723	CHF	954.110	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	25.10.2017	25.10.2019	38 486 717	CHF	986.960	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	25.10.2017	25.10.2019	38 486 728	CHF	898.810	96.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.10.2017	25.10.2019	38 486 753	%	96.480	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	25.10.2017	25.10.2019	38 486 746	CHF	1077.310	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	25.10.2017	25.10.2019	38 486 731	CHF	922.840	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	25.10.2017	25.10.2019	38 486 747	CHF	1018.610	96.480	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	25.10.2017	25.10.2019	38 486 726	CHF	918.260	96.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 26.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.797%	USD	1'000.00	26.10.2015	28.10.2019	28 884 185		-	95.490	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	26.10.2017	28.10.2019	38 486 756	CHF	1158.960	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	26.10.2017	28.10.2019	38 064 837	CHF	867.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	26.10.2017	28.10.2019	38 486 776	CHF	884.330	96.460	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	26.10.2017	28.10.2019	38 486 781	CHF	1117.440	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.10.2017	28.10.2019	38 486 780	%	99.270	96.450	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	26.10.2017	28.10.2019	38 486 777	CHF	920.110	96.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	26.10.2017	28.10.2019	38 486 757	CHF	1192.270	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	26.10.2017	28.10.2019	38 486 759	CHF	1093.310	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	26.10.2017	28.10.2019	38 486 762	CHF	1033.400	96.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	26.10.2017	28.10.2019	38 486 764	CHF	967.230	96.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	26.10.2017	28.10.2019	38 486 765	CHF	865.340	96.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	26.10.2017	28.10.2019	38 486 767	CHF	796.880	96.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	26.10.2017	28.10.2019	38 486 769	CHF	1032.450	96.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	26.10.2017	28.10.2019	38 486 768	CHF	966.530	96.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	26.10.2017	28.10.2019	38 486 771	CHF	947.060	96.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	26.10.2017	28.10.2019	38 486 772	CHF	919.340	96.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	26.10.2017	28.10.2019	38 486 773	CHF	949.350	96.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	26.10.2017	28.10.2019	38 486 775	CHF	975.380	96.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	26.10.2017	28.10.2019	38 486 774	CHF	910.010	96.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	26.10.2017	28.10.2019	38 486 778	CHF	928.470	96.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Vale Sp ADR	USD	1'000.00	26.10.2017	28.10.2019	38 486 779	CHF	1159.980	96.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	27.10.2017	28.10.2019	38 486 720	CHF	1023.780	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	27.10.2017	28.10.2019	38 486 798	CHF	829.270	96.480	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	27.10.2017	28.10.2019	38 486 786	CHF	1109.390	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	27.10.2017	28.10.2019	38 486 724	CHF	1012.810	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	27.10.2017	28.10.2019	38 486 730	CHF	910.230	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	27.10.2017	28.10.2019	38 486 722	CHF	941.360	96.550	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	30.10.2017	30.10.2019	38 486 799	CHF	1086.740	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	30.10.2017	30.10.2019	38 486 811	CHF	1020.970	96.490	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	30.10.2017	30.10.2019	38 486 810	CHF	898.470	96.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.393%	USD	1'000.00	31.10.2014	31.10.2019	24 439 684		-	92.010	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	31.10.2017	31.10.2019	38 486 824	CHF	840.930	96.490	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	31.10.2017	31.10.2019	38 486 816	CHF	1092.100	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	31.10.2017	31.10.2019	38 486 837	CHF	966.860	96.480	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	31.10.2017	31.10.2019	38 486 829	CHF	934.530	96.490	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	31.10.2017	31.10.2019	38 486 831	CHF	980.810	96.490	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	31.10.2017	31.10.2019	38 486 836	CHF	881.190	96.480	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	31.10.2017	31.10.2019	38 486 815	CHF	983.060	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	31.10.2017	31.10.2019	38 486 828	CHF	833.620	96.490	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	01.11.2017	01.11.2019	38 486 834	CHF	917.170	96.490	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	01.11.2017	01.11.2019	38 486 840	CHF	947.240	96.480	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	01.11.2017	01.11.2019	38 486 841	CHF	869.190	96.480	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	01.11.2017	01.11.2019	38 486 845	CHF	1013.040	96.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.11.2017	01.11.2019	38 486 852	%	101.400	96.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	01.11.2017	01.11.2019	38 486 849	CHF	852.480	96.480	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	01.11.2017	01.11.2019	38 486 851	CHF	890.680	96.480	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	01.11.2017	01.11.2019	38 486 820	CHF	991.990	96.490	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	01.11.2017	01.11.2019	38 486 826	CHF	888.650	96.490	100.000		0.000	Y
3.15 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	03.11.2016	04.11.2019	33 162 765	%	102.340	100.000	100.000	03.02. 03.05. 03.08. 03.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker on NASDAQ 100	USD	1'000.00	03.05.2017	04.11.2019	36 453 907	CHF	1108.010	95.990	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	04.05.2017	04.11.2019	36 453 921	CHF	1001.780	95.920	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.11.2017	04.11.2019	38 486 863	CHF	1015.290	96.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	02.11.2017	04.11.2019	38 486 865	CHF	1004.840	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.11.2017	04.11.2019	38 486 867	CHF	960.090	96.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.11.2017	04.11.2019	38 486 866	CHF	993.360	96.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.11.2017	04.11.2019	38 486 862	CHF	960.600	96.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.11.2017	04.11.2019	38 486 861	CHF	899.080	96.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.11.2017	04.11.2019	38 486 860	%	98.620	96.430	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.11.2017	04.11.2019	38 486 868	CHF	907.250	96.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.11.2017	04.11.2019	38 486 878	CHF	952.170	96.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	03.11.2017	04.11.2019	38 064 839	CHF	1170.150	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	03.11.2017	04.11.2019	38 486 871	CHF	1043.500	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.11.2017	04.11.2019	38 486 875	CHF	1018.700	96.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.11.2017	04.11.2019	38 486 870	CHF	969.130	96.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.11.2017	04.11.2019	38 486 876	CHF	948.290	96.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.11.2017	04.11.2019	38 486 874	CHF	977.390	96.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.11.2017	04.11.2019	38 486 873	CHF	966.600	96.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.11.2017	04.11.2019	38 486 879	CHF	950.230	96.440	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	06.11.2017	06.11.2019	38 486 882	CHF	1173.070	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.11.2017	06.11.2019	38 486 881	%	95.700	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.11.2017	07.11.2019	38 486 905	%	100.070	96.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.11.2017	07.11.2019	38 486 904	%	94.990	96.470	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	07.11.2017	07.11.2019	38 486 900	CHF	1005.630	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	07.11.2017	07.11.2019	38 486 899	CHF	968.560	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.11.2017	07.11.2019	38 486 856	CHF	930.620	96.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on IBEX 35	EUR	1'000.00	07.11.2017	07.11.2019	38 486 891	CHF	1097.960	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.11.2017	07.11.2019	38 486 902	%	97.990	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.11.2017	07.11.2019	38 486 896	CHF	799.810	96.480	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Credit Agricole	EUR	1'000.00	07.11.2017	07.11.2019	38 486 894	CHF	1041.910	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.11.2017	08.11.2019	38 486 916	%	98.900	96.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	08.11.2017	08.11.2019	38 486 914	CHF	856.890	96.480	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	08.11.2017	08.11.2019	38 486 913	CHF	1114.060	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	08.11.2017	08.11.2019	38 486 906	CHF	937.370	96.480	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	08.11.2017	08.11.2019	38 486 912	CHF	1127.350	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	08.11.2017	08.11.2019	38 486 909	CHF	1136.300	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	08.11.2017	08.11.2019	38 486 915	CHF	889.400	96.480	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.05.2017	11.11.2019	35 765 807	%	97.310	100.000	100.000	11.08. 13.11.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	10.11.2017	11.11.2019	38 486 924	CHF	1108.490	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.11.2017	12.11.2019	38 486 920	%	96.600	96.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	09.11.2017	12.11.2019	38 064 888	CHF	918.920	96.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.11.2017	12.11.2019	38 486 929	CHF	925.870	96.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.11.2017	12.11.2019	38 486 927	CHF	914.060	96.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	14.11.2017	14.11.2019	38 486 943	CHF	934.110	96.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	14.11.2017	14.11.2019	38 486 893	CHF	935.490	96.420	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	14.11.2017	14.11.2019	38 486 944	CHF	948.490	96.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	14.11.2017	14.11.2019	38 486 945	CHF	935.810	96.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	14.11.2017	14.11.2019	38 486 946	CHF	928.450	96.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	14.11.2017	14.11.2019	38 486 947	CHF	908.360	96.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	14.11.2017	14.11.2019	38 486 948	CHF	888.420	96.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	14.11.2017	14.11.2019	38 486 952	CHF	917.060	96.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.11.2017	14.11.2019	38 486 949	%	100.460	96.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	14.11.2017	14.11.2019	38 486 838	%	99.700	96.480	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	15.11.2017	15.11.2019	38 486 967	CHF	1014.610	96.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on BNP Paribas P-A	EUR	1'000.00	15.11.2017	15.11.2019	38 486 958	CHF	1097.200	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 16.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.956%	USD	1'000.00	16.11.2016	18.11.2019	32 219 922		-	96.570	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	17.05.2017	18.11.2019	36 454 045	CHF	1184.680	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.11.2017	18.11.2019	38 486 986	%	97.000	96.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.11.2017	18.11.2019	38 486 992	CHF	965.330	96.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	17.11.2017	18.11.2019	38 486 994	CHF	1013.070	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur Gr N	CHF	1'000.00	17.11.2017	18.11.2019	38 486 999	CHF	960.740	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.11.2017	18.11.2019	38 487 003	CHF	913.260	96.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.11.2017	18.11.2019	38 487 005	CHF	918.850	96.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.11.2017	18.11.2019	38 487 006	CHF	956.180	96.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.11.2017	18.11.2019	38 487 007	CHF	935.300	96.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.11.2017	18.11.2019	38 487 008	CHF	943.670	96.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.11.2017	18.11.2019	38 487 009	CHF	980.280	96.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.11.2017	18.11.2019	38 487 014	CHF	971.640	96.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	17.11.2017	18.11.2019	38 487 015	CHF	877.430	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	17.11.2017	18.11.2019	38 064 887	CHF	1197.060	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	20.11.2019	38 487 020	%	97.710	96.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	20.11.2019	38 487 022	%	100.550	96.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	20.11.2019	38 487 025	%	98.280	96.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	20.11.2019	38 487 028	%	98.730	96.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	20.11.2019	38 487 021	CHF	895.650	96.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	20.11.2017	20.11.2019	38 487 023	CHF	1119.140	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	20.11.2017	20.11.2019	38 487 017	%	100.200	96.340	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	20.11.2019	38 487 026	CHF	968.140	96.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	20.11.2019	38 487 027	CHF	928.130	96.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	20.11.2017	20.11.2019	38 487 029	CHF	1191.080	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	20.11.2019	38 487 030	CHF	923.580	96.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	20.11.2019	38 487 032	CHF	931.930	96.360	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	20.11.2019	38 487 033	CHF	972.580	96.360	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	20.11.2019	38 487 024	CHF	1010.100	96.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.11.2017	21.11.2019	38 486 957	%	98.600	96.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur Gr N	CHF	1'000.00	21.11.2017	21.11.2019	38 487 036	CHF	978.530	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	21.11.2017	21.11.2019	38 487 037	CHF	966.970	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	21.11.2017	21.11.2019	38 487 042	CHF	976.590	96.360	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	21.11.2017	21.11.2019	38 487 044	CHF	927.230	96.360	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	21.11.2017	21.11.2019	38 487 045	CHF	927.210	96.360	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	21.11.2017	21.11.2019	38 487 052	CHF	885.510	96.360	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	21.11.2017	21.11.2019	38 487 053	CHF	928.720	96.360	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	21.11.2017	21.11.2019	38 487 055	CHF	968.310	96.360	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	21.11.2017	21.11.2019	38 487 056	CHF	923.080	96.360	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	21.11.2017	21.11.2019	38 487 059	CHF	931.140	96.360	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on General Electric Rg	USD	1'000.00	21.11.2017	21.11.2019	38 487 062	CHF	935.860	96.340	100.000		0.000	Y
3.2 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	24.11.2016	25.11.2019	33 162 804	%	102.440	100.000	100.000	24.02. 24.05. 24.08. 24.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
4.50 % Reverse Convertible on Indices 27.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	25.11.2016	25.11.2019	33 162 829		-	100.000	100.000	27.02. 27.05. 27.08. 27.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
5.57 % Reverse Convertible on Indices 27.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	25.11.2016	25.11.2019	32 220 008		-	100.000	100.000	27.02. 26.05. 25.08. 27.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	23.05.2017	25.11.2019	36 454 127	%	99.000	96.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	23.05.2017	25.11.2019	35 765 850	%	98.700	100.000	100.000		0.000	Y
6.9 % Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	24.05.2017	25.11.2019	36 454 026	%	98.200	100.000	100.000	24.08. 24.11.	1.728 1.830	N
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	23.11.2017	25.11.2019	38 064 897	CHF	1007.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.11.2017	25.11.2019	38 487 083	CHF	942.810	96.370	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.11.2017	25.11.2019	38 487 082	CHF	914.620	96.370	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.11.2017	25.11.2019	38 487 079	CHF	962.990	96.370	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.11.2017	25.11.2019	38 487 076	CHF	966.310	96.370	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.11.2017	25.11.2019	38 487 084	CHF	924.900	96.370	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.11.2017	25.11.2019	38 487 085	CHF	922.830	96.370	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.11.2017	25.11.2019	38 487 086	CHF	942.630	96.370	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.11.2017	25.11.2019	38 487 087	CHF	1012.480	96.370	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	24.11.2017	25.11.2019	38 487 088	CHF	1041.130	96.370	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Orange	EUR	1'000.00	24.11.2017	25.11.2019	38 487 091	CHF	1206.150	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Orange	EUR	1'000.00	24.11.2017	25.11.2019	38 487 092	CHF	1206.840	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ING Group Rg	EUR	1'000.00	24.11.2017	25.11.2019	38 487 093	CHF	1161.080	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ING Group Rg	EUR	1'000.00	24.11.2017	25.11.2019	38 487 094	CHF	1158.910	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	24.11.2017	25.11.2019	38 487 095	CHF	1009.070	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	24.11.2017	25.11.2019	38 486 969	%	98.800	96.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	24.11.2017	25.11.2019	38 486 972	%	99.200	96.420	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	26.05.2017	26.11.2019	36 454 165	CHF	993.160	96.200	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Vale Sp ADR	USD	1'000.00	27.11.2017	27.11.2019	38 487 096	CHF	1165.480	96.320	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	28.11.2017	28.11.2019	38 487 117	CHF	1133.890	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	29.05.2017	29.11.2019	35 765 845	CHF	1217.000	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	31.05.2017	29.11.2019	35 765 847	%	96.630	100.000	100.000	31.08. 30.11.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	31.05.2017	29.11.2019	36 454 183	%	97.420	96.130	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	29.11.2017	29.11.2019	38 487 115	CHF	925.010	96.300	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	29.11.2017	29.11.2019	38 487 113	CHF	954.980	96.300	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	29.11.2017	29.11.2019	38 487 111	CHF	1000.300	96.300	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	29.11.2017	29.11.2019	38 487 110	CHF	862.860	96.300	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	29.11.2017	29.11.2019	38 487 119	CHF	888.590	96.250	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	29.11.2017	29.11.2019	38 487 114	CHF	929.020	96.300	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	30.11.2017	29.11.2019	38 487 134	CHF	962.120	96.250	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	30.11.2017	29.11.2019	38 487 132	CHF	1008.590	96.250	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.11.2017	29.11.2019	38 487 140	%	98.600	96.270	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	30.11.2017	29.11.2019	38 487 130	CHF	1032.840	96.250	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	30.11.2017	29.11.2019	38 487 128	CHF	861.110	96.250	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	30.11.2017	29.11.2019	38 487 127	CHF	948.440	96.250	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	30.11.2017	29.11.2019	38 487 126	CHF	906.530	96.250	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	30.11.2017	29.11.2019	38 487 143	CHF	1138.830	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	30.11.2017	29.11.2019	38 487 142	CHF	986.630	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	30.11.2017	29.11.2019	38 487 154	CHF	931.590	96.270	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	30.11.2017	29.11.2019	38 487 067	CHF	941.340	96.290	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	30.11.2017	29.11.2019	38 487 145	CHF	1136.480	100.000	100.000		0.000	Y
5.3 % Reverse Convertible on Indices 2.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	02.12.2016	02.12.2019	32 220 005		-	100.000	100.000	02.06.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	01.12.2017	02.12.2019	38 487 148	CHF	999.790	96.260	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	01.12.2017	02.12.2019	38 487 149	CHF	1107.730	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Credit Agricole	EUR	1'000.00	01.12.2017	02.12.2019	38 487 146	CHF	1113.950	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	01.12.2017	02.12.2019	38 487 147	CHF	922.490	96.260	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	04.12.2017	04.12.2019	38 487 160	CHF	895.790	96.240	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	04.12.2017	04.12.2019	38 487 159	CHF	901.310	96.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	05.12.2017	05.12.2019	38 487 090	%	99.000	96.340	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	05.12.2017	05.12.2019	38 487 168	CHF	905.380	96.240	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	05.12.2017	05.12.2019	38 487 171	CHF	903.150	96.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	06.12.2017	06.12.2019	38 487 178	%	98.610	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTXBnk EUR P	EUR	1'000.00	09.06.2017	09.12.2019	35 568 639	CHF	1191.210	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	07.12.2017	09.12.2019	38 487 187	%	99.400	96.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.12.2017	09.12.2019	38 487 181	%	99.160	96.220	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.12.2017	09.12.2019	38 487 184	CHF	972.310	96.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.12.2017	09.12.2019	38 487 183	%	99.280	96.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.12.2017	09.12.2019	38 487 182	%	99.170	96.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Volkswagen Vz I	EUR	1'000.00	08.12.2017	09.12.2019	38 487 188	%	97.730	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	08.12.2017	09.12.2019	38 487 190	%	100.000	96.170	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	08.12.2017	09.12.2019	38 064 915	CHF	1021.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.12.2017	11.12.2019	38 487 202	CHF	945.950	96.150	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.12.2017	11.12.2019	38 487 198	CHF	932.910	96.150	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.12.2017	11.12.2019	38 487 203	CHF	974.750	96.150	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.12.2017	11.12.2019	38 487 204	CHF	960.160	96.150	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.12.2017	11.12.2019	38 487 208	CHF	981.870	96.130	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.12.2017	11.12.2019	38 487 206	CHF	925.120	96.150	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.12.2017	11.12.2019	38 487 205	CHF	956.050	96.150	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	12.12.2017	12.12.2019	38 487 210	CHF	1010.010	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	13.12.2017	13.12.2019	38 487 232	%	99.800	96.170	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	1'000.00	13.12.2017	13.12.2019	38 487 221	CHF	971.930	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Lukoil Sp ADR	USD	1'000.00	13.12.2017	13.12.2019	38 487 233	CHF	959.930	96.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.12.2017	13.12.2019	38 487 236	%	99.740	96.110	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on NASDAQ 100	USD	1'000.00	14.12.2017	16.12.2019	38 487 249	CHF	1030.990	96.120	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Indices	USD	1'000.00	14.12.2017	16.12.2019	38 487 226	CHF	959.850	96.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.12.2017	16.12.2019	38 487 241	%	99.760	96.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	15.12.2017	16.12.2019	38 487 251	%	99.000	96.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	15.12.2017	16.12.2019	38 487 252	%	99.500	96.110	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Indices	USD	1'000.00	18.12.2014	18.12.2019	24 439 871	%	113.700	87.240	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 19.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.706%	USD	1'000.00	18.12.2015	18.12.2019	30 485 041		-	94.290	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	18.12.2017	18.12.2019	38 487 254	CHF	1026.480	96.130	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	18.12.2017	18.12.2019	38 487 260	CHF	995.520	96.130	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.12.2017	19.12.2019	38 487 272	CHF	925.450	96.110	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.12.2017	19.12.2019	38 487 268	CHF	945.130	96.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	5'000.00	19.12.2017	19.12.2019	38 487 278	%	92.200	96.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.12.2017	19.12.2019	38 487 277	%	94.400	96.060	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.12.2017	19.12.2019	38 487 267	CHF	961.780	96.110	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.12.2017	19.12.2019	38 487 266	CHF	942.000	96.110	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.12.2017	19.12.2019	38 487 273	CHF	926.120	96.110	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.12.2017	19.12.2019	38 487 275	CHF	932.920	96.050	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	19.12.2017	19.12.2019	38 487 271	CHF	929.540	96.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	20.12.2017	20.12.2019	38 064 974	%	98.900	96.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	20.12.2017	20.12.2019	38 064 975	%	99.500	96.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	20.12.2017	20.12.2019	38 064 957	%	100.300	96.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	23.12.2014	23.12.2019	24 439 882	%	145.950	91.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.12.2017	23.12.2019	38 487 299	%	96.970	96.070	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	21.12.2017	23.12.2019	38 487 293	CHF	955.540	96.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.12.2017	23.12.2019	38 487 301	%	99.400	96.070	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	21.12.2017	23.12.2019	38 487 291	CHF	936.300	96.070	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	21.12.2017	23.12.2019	38 487 292	CHF	947.950	96.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	21.12.2017	23.12.2019	38 487 288	%	99.600	96.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.12.2017	23.12.2019	38 487 287	%	97.270	96.070	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	21.12.2017	23.12.2019	38 487 289	CHF	927.120	96.070	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	21.12.2017	23.12.2019	38 487 290	CHF	938.470	96.070	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	24.12.2015	24.12.2019	30 112 540	%	114.850	94.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.12.2016	27.12.2019	32 220 144	%	100.800	95.410	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
3 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	11.07.2017	27.12.2019	36 852 004	%	98.680	100.000	100.000	27.09. 27.12.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	27.12.2017	27.12.2019	38 487 314	CHF	920.990	96.050	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	27.12.2017	27.12.2019	38 487 303	CHF	980.110	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	27.12.2017	27.12.2019	38 487 317	CHF	919.590	96.050	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	28.12.2016	30.12.2019	34 468 427	CHF	1157.000	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 29.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.334% 29.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	30.12.2016	30.12.2019	34 906 081	%	-	94.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	22.12.2017	30.12.2019	38 487 308	%	99.500	96.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	28.12.2017	30.12.2019	38 487 331	%	99.190	96.010	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	13.01.2017	13.01.2020	34 906 130	CHF	1128.930	95.230	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	13.01.2017	13.01.2020	34 468 440	CHF	1128.000	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 23.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.961%	USD	1'000.00	21.01.2016	21.01.2020	30 012 880		-	94.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	23.01.2017	23.01.2020	34 906 216	%	100.600	95.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 24.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	23.01.2017	23.01.2020	34 906 225		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 24.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	23.01.2017	23.01.2020	34 906 226		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 24.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.248%	USD	1'000.00	23.01.2017	23.01.2020	34 906 224		-	95.210	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 23.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.418%	USD	1'000.00	23.01.2017	23.01.2020	34 906 208		-	95.210	100.000		0.000	Y
3.5 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	25.01.2016	27.01.2020	30 012 882	%	104.210	100.000	100.000	25.01. 25.07.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Euro Stoxx 50-Index 26.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.366%	USD	1'000.00	26.01.2016	27.01.2020	30 012 887		-	94.620	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	27.01.2017	27.01.2020	34 906 283	CHF	1245.530	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation	USD	1'000.00	26.01.2017	28.01.2020	34 112 948	%	100.600	94.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 30.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.665%	USD	1'000.00	29.01.2016	29.01.2020	30 485 175		-	94.960	100.000		0.000	Y
LastLook Express-Cert. on Russel 2000 31.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.50%	USD	1.00	24.01.2014	31.01.2020	22 593 748		-	88.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 3.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.196%	USD	1'000.00	03.02.2017	03.02.2020	34 906 388		-	94.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	07.02.2017	07.02.2020	34 906 419	%	100.600	95.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	09.02.2017	10.02.2020	34 906 451	%	101.810	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 9.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.129%	USD	1'000.00	09.02.2017	10.02.2020	34 906 462		-	94.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	10.02.2017	10.02.2020	34 906 471	%	100.400	95.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	10.02.2017	10.02.2020	34 906 469	%	100.800	95.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 13.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.338%	USD	1'000.00	12.02.2016	12.02.2020	30 485 282		-	95.740	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	13.02.2017	13.02.2020	34 906 491	CHF	1239.560	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 15.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.316%	USD	1'000.00	14.02.2017	14.02.2020	34 906 522		-	95.100	100.000	15.05.	14.949	Y
Reverse Convertible on IBEX 35 15.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	15.02.2017	17.02.2020	34 906 525		-	100.000	100.000		0.000	Y
3.30 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	18.02.2016	18.02.2020	30 012 891	%	104.320	100.000	100.000	20.02. 18.08.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	21.02.2017	21.02.2020	34 906 577	%	100.300	94.980	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	22.02.2017	24.02.2020	34 906 602	CHF	1247.670	100.000	100.000		0.000	Y
UnderlyingTracker on S&P 500-Index	USD	1'000.00	25.02.2015	25.02.2020	27 033 331	%	114.650	77.860	85.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 28.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.162%	USD	1'000.00	28.02.2017	28.02.2020	34 906 687		-	94.870	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	28.02.2017	28.02.2020	34 906 673	CHF	1090.600	94.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	02.03.2015	02.03.2020	25 232 410	%	105.700	98.510	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 4.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	02.03.2017	02.03.2020	34 468 546		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	03.03.2017	03.03.2020	34 906 760	CHF	1090.970	94.990	100.000		0.000	Y
Express Certificates with Memory Payout on ESTX50 EUR P 6.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.427%	GBP	1.00	06.03.2014	06.03.2020	22 593 730		-	88.070	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	07.03.2017	09.03.2020	34 906 813	CHF	1240.230	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	08.03.2017	09.03.2020	34 906 827	CHF	1080.700	95.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 12.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.664%	USD	1'000.00	11.03.2015	11.03.2020	25 232 500		-	91.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	16.03.2015	16.03.2020	25 232 532	%	106.900	98.510	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	14.03.2017	16.03.2020	34 906 910	CHF	1080.350	94.620	100.000		0.000	Y
2.4 % Structured Note Credit Linked on Anglo American Capital Plc	EUR	1'000.00	18.02.2015	20.03.2020	26 574 171	%	104.480	100.000	100.000	20.03.	25.722	N
3.75 % Structured Note Credit Linked on Israel Electric Corp. Ltd	USD	1'000.00	23.02.2015	20.03.2020	27 033 321	%	101.560	100.000	100.000	20.03.	37.374	N
(3.5 % min. - 6 % max.) Structured Note Credit Linked on Emirate of Dubai floating rate	USD	1'000.00	13.03.2015	20.03.2020	27 033 341	%	98.610	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	8.720 8.539 8.415 8.615	N
LastLook Express-Cert. on FTSE 100-Index 24.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.427%	GBP	1.00	24.03.2014	24.03.2020	22 593 732		-	88.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	24.03.2017	24.03.2020	36 044 033	%	98.900	94.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.03.2017	24.03.2020	34 906 977	%	85.500	94.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	27.03.2017	27.03.2020	36 044 065	%	99.100	94.650	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	30.03.2016	30.03.2020	31 562 240	%	108.100	94.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 29.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	30.03.2017	30.03.2020	36 044 112	%	-	94.760	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	01.04.2015	01.04.2020	27 033 343	%	98.900	92.730	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	03.04.2017	03.04.2020	36 044 188	CHF	1066.450	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	06.04.2017	06.04.2020	36 044 244	CHF	1176.110	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	07.04.2017	07.04.2020	36 044 265	CHF	1176.730	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Gold	GBP	1'000.00	07.04.2017	07.04.2020	35 568 604	%	102.600	97.810	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Crude Oil Barrel	USD	1'000.00	10.10.2017	09.04.2020	37 357 520	CHF	1009.550	95.640	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI-Index	USD	1'000.00	17.04.2015	17.04.2020	27 033 380	%	98.100	92.600	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	17.04.2015	17.04.2020	27 033 379	%	98.270	92.600	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	18.04.2017	20.04.2020	35 568 616	%	99.700	95.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	19.04.2017	20.04.2020	36 044 412	%	101.380	94.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 23.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.121%	USD	1'000.00	21.04.2017	21.04.2020	36 044 431		-	95.120	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	24.04.2015	24.04.2020	27 033 404	%	97.800	92.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 30.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.355%	USD	1'000.00	28.04.2015	28.04.2020	25 232 749		-	92.870	100.000		0.000	Y
(no min.) Reverse Convertible on Shares-Basket 28.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	31.03.2015	30.04.2020	25 232 611		-	92.620	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI-Index	USD	1'000.00	01.05.2015	01.05.2020	27 033 392	%	98.510	92.960	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	01.05.2015	01.05.2020	27 033 391	%	97.690	92.960	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	04.05.2015	04.05.2020	27 033 408	%	98.670	92.830	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	01.11.2017	04.05.2020	38 064 852	CHF	1013.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	05.05.2017	05.05.2020	36 453 922	CHF	1012.750	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 6.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.999%	GBP	1'000.00	05.05.2017	05.05.2020	35 568 624		-	98.100	100.000		0.000	Y
Express Certificates with Memory Payout on ESTX50 EUR P 9.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.355%	USD	1.00	07.05.2014	07.05.2020	22 593 756		-	88.540	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 7.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.637%	USD	1'000.00	07.02.2017	07.05.2020	34 906 414		-	94.520	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	11.05.2015	11.05.2020	28 012 755	%	97.000	89.020	90.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	09.05.2017	11.05.2020	35 765 780	CHF	1028.000	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	10.05.2017	11.05.2020	35 568 626	%	99.800	98.130	100.000		0.000	Y
Structured Note auf S&P 500-Index	USD	1'000.00	15.05.2015	15.05.2020	28 012 749	%	106.140	92.230	100.000		0.000	Y
Structured Note auf SMI-Index	USD	1'000.00	15.05.2015	15.05.2020	27 033 418	%	99.260	92.230	100.000		0.000	Y
Structured Note auf Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	15.05.2015	15.05.2020	28 012 748	%	97.970	92.230	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	16.05.2017	18.05.2020	36 454 040	CHF	1053.610	94.880	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	16.05.2017	18.05.2020	36 454 039	CHF	993.600	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	17.05.2017	18.05.2020	35 765 816	CHF	976.500	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	19.05.2015	19.05.2020	28 012 782	%	100.680	91.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 22.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	20.05.2016	20.05.2020	32 219 224		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	24.05.2017	25.05.2020	36 454 133	CHF	995.230	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	25.05.2017	26.05.2020	36 454 153	%	99.270	95.280	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on iShs MSCI Em Mk	USD	1'000.00	26.05.2017	26.05.2020	36 454 169	CHF	1092.770	95.270	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	27.11.2017	27.05.2020	38 487 106	CHF	1127.570	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	28.05.2015	28.05.2020	25 232 897	%	99.400	91.920	100.000	28.11.	0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	28.05.2015	28.05.2020	25 232 896	%	100.490	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on S&P 500	USD	1'000.00	29.05.2015	29.05.2020	28 012 769	%	105.940	91.960	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	29.05.2015	29.05.2020	28 012 771	%	99.710	91.960	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	29.05.2015	29.05.2020	28 012 770	%	98.550	91.960	100.000		0.000	Y
Protection Participation on STXE S50EURP	USD	1'000.00	30.05.2017	29.05.2020	35 568 630	%	96.100	94.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	01.06.2015	01.06.2020	25 232 914	%	100.480	92.110	100.000		0.000	Y
LastLook Capped Bonus Outperformance-Zert. auf Euro Stoxx 50-Index	GBP	1.00	06.06.2014	08.06.2020	23 651 565	CHF	1.580	87.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	06.06.2017	08.06.2020	36 454 226	%	98.700	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	06.06.2017	08.06.2020	36 454 228	%	98.100	95.210	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 7.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.208%	USD	1'000.00	07.06.2017	08.06.2020	35 568 641		-	95.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	07.06.2017	08.06.2020	35 765 882	%	99.020	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	CHF	1'000.00	08.06.2017	08.06.2020	36 454 184	CHF	1003.000	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	09.12.2015	09.06.2020	30 485 034	%	100.000	93.520	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	09.06.2017	09.06.2020	35 765 869	CHF	977.000	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI-Index	USD	1'000.00	11.06.2015	11.06.2020	28 012 808	%	100.300	91.600	100.000		0.000	Y
Structured Note on S&P 500-Index	USD	1'000.00	12.06.2015	12.06.2020	28 012 793	%	105.840	91.150	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI-Index	USD	1'000.00	12.06.2015	12.06.2020	28 012 791	%	101.870	91.150	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	12.06.2015	12.06.2020	28 012 792	%	101.250	91.150	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	12.06.2017	12.06.2020	36 454 274	CHF	1005.490	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	CHF	1'000.00	12.06.2017	12.06.2020	36 454 275	CHF	952.410	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	13.06.2017	15.06.2020	36 454 293	%	98.200	95.290	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	15.06.2017	15.06.2020	35 765 881	CHF	899.000	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 18.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.608%	USD	1'000.00	16.06.2015	16.06.2020	25 232 960		-	91.740	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	16.06.2017	16.06.2020	36 454 325	CHF	1114.320	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	18.12.2017	18.06.2020	38 487 102	%	99.300	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 19.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.851%	EUR	1'000.00	19.06.2015	19.06.2020	25 233 027		-	97.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 19.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.851%	EUR	1'000.00	19.06.2015	19.06.2020	25 233 026		-	97.300	100.000		0.000	Y
1.4 % Structured Note Credit Linked on Glencore International AG	CHF	1'000.00	24.06.2015	22.06.2020	28 012 813	%	101.270	100.000	100.000	21.03. 20.06. 20.09. 21.12.	3.538 3.500 3.500 3.538	N
2.1 % Structured Note Credit Linked on Vale S.A.	CHF	1'000.00	30.06.2015	22.06.2020	28 012 822	%	103.790	100.000	100.000	20.06.	21.000	N
6 % StructuredNote Credit Linked on Markit iTraxx Europe Cross	EUR	846.66	14.07.2015	22.06.2020	28 012 842	%	111.140	100.000	100.000	20.06.	61.675	N
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	20.06.2017	22.06.2020	36 454 355	%	97.500	95.120	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 31.12.2017 CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 20.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.111%	USD	1'000.00	20.06.2017	22.06.2020	36 454 357		-	95.120	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	21.12.2017	22.06.2020	38 064 937	CHF	985.500	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 23.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	23.06.2015	23.06.2020	25 233 043		-	97.260	100.000	23.06.	0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 26.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	26.06.2015	26.06.2020	25 233 078		-	97.390	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 29.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.314%	USD	1'000.00	29.06.2015	29.06.2020	25 233 083		-	91.840	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	29.06.2015	29.06.2020	28 012 820	%	103.000	91.330	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	28.06.2017	29.06.2020	36 454 415	CHF	1138.430	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	28.06.2017	29.06.2020	36 454 433	%	101.300	95.150	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	30.03.2017	30.06.2020	36 044 115	CHF	1028.670	94.120	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	03.07.2015	03.07.2020	28 012 811	%	102.660	91.150	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	03.07.2015	03.07.2020	28 012 812	%	100.620	91.150	100.000		0.000	Y
Express Certificates with Memory Payout on ESTX50 EUR P 5.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1.00	07.07.2014	06.07.2020	23 651 579		-	88.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Index-Basket	USD	1'000.00	08.07.2015	08.07.2020	25 233 148	%	100.700	91.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	10.07.2017	10.07.2020	36 454 516	%	101.200	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	10.07.2017	10.07.2020	36 454 500	CHF	1043.330	95.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 13.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.579%	EUR	1'000.00	13.07.2015	13.07.2020	25 233 166		-	97.570	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Russell 2000	USD	1'000.00	12.07.2017	13.07.2020	37 357 491	CHF	985.190	94.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	13.07.2017	13.07.2020	36 454 547	%	97.800	94.790	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	13.07.2017	13.07.2020	36 852 003	CHF	1010.000	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	17.07.2015	17.07.2020	28 012 836	%	101.640	91.560	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	17.07.2015	17.07.2020	28 012 835	%	102.120	91.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Index-Basket 20.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.556%	EUR	1'000.00	20.07.2015	20.07.2020	25 233 202		-	97.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Siemens N	EUR	1'000.00	27.01.2017	27.07.2020	34 906 287	CHF	1188.870	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	26.07.2017	27.07.2020	36 454 668	CHF	1098.230	95.010	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	26.07.2017	27.07.2020	36 454 665	CHF	995.370	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	USD	1'000.00	27.07.2017	27.07.2020	36 454 677	CHF	997.860	95.040	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	27.07.2017	27.07.2020	36 454 671	CHF	985.740	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 3.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	03.08.2016	03.08.2020	31 883 921		-	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Air Liquide	USD	1'000.00	01.02.2017	03.08.2020	34 906 341	%	100.600	93.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	02.08.2017	03.08.2020	36 454 705	%	100.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	04.08.2017	04.08.2020	36 454 729	CHF	1001.870	100.000	100.000		0.000	Y
Express Certificates with Memory Payout on ESTX50 EUR P 7.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.341%	USD	1.00	07.08.2014	07.08.2020	24 334 943		-	88.170	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	07.08.2015	07.08.2020	28 845 373	%	100.550	92.050	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Hang Seng China Ent-Index	USD	1'000.00	07.08.2015	07.08.2020	28 845 395	%	102.500	91.650	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	07.08.2015	07.08.2020	28 845 374	%	100.690	92.050	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	12.08.2015	12.08.2020	28 845 399	%	97.000	91.560	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	13.11.2017	13.08.2020	38 064 878	CHF	958.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	16.02.2017	17.08.2020	34 906 552	CHF	1229.530	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	24.08.2017	24.08.2020	37 823 406	%	99.200	95.120	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	28.08.2015	28.08.2020	28 845 400	%	103.860	92.640	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	28.08.2015	28.08.2020	28 845 402	%	105.050	92.640	100.000		0.000	Y
Protection Participation on HS China Ent Index	USD	1'000.00	28.08.2015	28.08.2020	28 845 401	%	109.620	92.640	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	28.08.2017	28.08.2020	36 852 093	CHF	983.000	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	31.08.2017	31.08.2020	37 357 509	%	98.500	95.210	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	01.09.2017	01.09.2020	36 852 108	%	99.430	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	01.09.2017	01.09.2020	37 823 481	CHF	1029.950	95.180	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	03.03.2017	03.09.2020	34 468 539	CHF	1239.180	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 6.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.91%	USD	1'000.00	04.09.2015	04.09.2020	28 884 046		-	92.410	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on CS Group N	CHF	1'000.00	04.09.2017	04.09.2020	36 454 838	CHF	680.000	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	09.09.2015	09.09.2020	28 845 418	%	102.300	92.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 9.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.941%	USD	1'000.00	09.09.2015	09.09.2020	28 884 025		-	92.460	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Hang Seng China Enterpr.-Index	USD	1'000.00	11.09.2015	11.09.2020	28 845 416	%	110.790	92.600	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	11.09.2015	11.09.2020	28 845 415	%	105.000	92.600	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	14.09.2017	14.09.2020	36 852 133	CHF	990.000	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 18.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.908%	GBP	1'000.00	17.09.2014	17.09.2020	24 439 481		-	88.280	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	21.03.2017	21.09.2020	34 468 566	CHF	1239.180	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	19.09.2017	21.09.2020	37 823 618	%	98.630	95.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	19.09.2017	21.09.2020	37 357 515	%	100.100	95.180	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 26.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.766%	GBP	1.00	26.09.2014	28.09.2020	24 334 965		-	87.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 26.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.487%	USD	1'000.00	26.09.2016	28.09.2020	32 219 690		-	95.490	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	28.09.2017	28.09.2020	36 852 163	CHF	984.500	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	31.03.2017	30.09.2020	36 044 012	CHF	915.030	93.530	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	03.02.2017	05.10.2020	34 468 480	CHF	1390.130	99.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 7.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.339%	EUR	1'000.00	07.10.2015	07.10.2020	28 884 149		-	98.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	11.10.2017	13.10.2020	38 486 547	%	96.350	94.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	13.10.2017	13.10.2020	38 486 619	CHF	976.680	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	19.10.2015	19.10.2020	24 875 006	%	101.840	93.050	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	17.02.2017	19.10.2020	34 468 503	CHF	1400.660	100.000	100.000		0.000	Y
3.15 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	19.10.2017	19.10.2020	38 064 814	%	98.110	100.000	100.000		0.000	N
Reverse Convertible on Indices 26.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.763%	GBP	1'000.00	24.10.2016	26.10.2020	32 219 833		-	97.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	24.10.2017	26.10.2020	38 486 740	%	97.400	94.470	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on IBEX 35	EUR	1'000.00	26.10.2017	26.10.2020	38 486 758	CHF	1128.340	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 27.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.581%	EUR	1'000.00	27.10.2015	27.10.2020	28 884 194		-	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 27.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.537%	EUR	1'000.00	27.10.2015	27.10.2020	28 884 196		-	98.230	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on IBEX 35	EUR	1'000.00	27.10.2017	27.10.2020	38 486 787	CHF	1131.710	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on IBEX 35	EUR	1'000.00	27.10.2017	27.10.2020	38 486 789	CHF	1129.520	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 28.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.537%	EUR	1'000.00	28.10.2015	28.10.2020	28 884 198		-	98.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 30.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.269%	EUR	1'000.00	28.10.2015	28.10.2020	28 884 197		-	98.230	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on NASDAQ 100	USD	1'000.00	31.10.2017	30.10.2020	38 486 832	CHF	1007.960	94.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 2.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.488%	EUR	1'000.00	02.11.2015	02.11.2020	28 884 206		-	98.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	01.11.2017	02.11.2020	38 486 855	%	97.100	94.330	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Commodities	USD	1'000.00	02.11.2017	02.11.2020	37 357 523	CHF	965.700	94.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	03.11.2017	03.11.2020	38 486 872	%	99.700	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 4.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	04.11.2015	04.11.2020	28 884 207		-	98.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 8.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.515%	USD	1'000.00	06.11.2015	06.11.2020	28 884 215		-	92.770	100.000	08.05.	0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	06.11.2015	06.11.2020	28 884 205	%	101.100	93.190	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	08.11.2017	09.11.2020	38 486 907	CHF	986.000	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 11.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.621%	EUR	1'000.00	11.11.2015	11.11.2020	28 884 228		-	98.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 14.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.591%	USD	1'000.00	12.11.2015	12.11.2020	28 884 227		-	92.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 13.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.405%	EUR	1'000.00	13.11.2015	13.11.2020	24 875 046		-	98.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 15.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.478%	EUR	1'000.00	13.11.2015	13.11.2020	28 884 246		-	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 15.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	13.11.2015	13.11.2020	28 884 245		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nikkei 225	EUR	1'000.00	13.11.2017	13.11.2020	37 357 524	CHF	1164.290	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	16.11.2015	16.11.2020	28 884 247	CHF	1012.870	92.590	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	15.11.2017	16.11.2020	38 486 963	CHF	1092.990	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	15.11.2017	16.11.2020	38 486 964	CHF	1093.340	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	15.11.2017	16.11.2020	38 486 960	CHF	1092.650	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	16.11.2017	16.11.2020	38 486 976	%	96.900	94.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	16.11.2017	16.11.2020	38 486 980	%	97.200	94.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	16.11.2017	16.11.2020	38 486 973	%	97.100	94.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 17.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.442%	EUR	1'000.00	17.11.2015	17.11.2020	28 884 251		-	98.540	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	17.11.2015	17.11.2020	28 884 253	CHF	1258.980	98.740	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	18.11.2015	18.11.2020	29 612 637	%	101.350	92.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 18.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.52%	USD	1'000.00	18.11.2015	18.11.2020	28 884 250		-	91.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	24.05.2017	24.11.2020	36 454 149	%	98.800	94.530	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	28.11.2017	30.11.2020	38 487 105	CHF	986.690	94.250	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	29.11.2017	30.11.2020	38 487 137	%	98.050	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Commodities	USD	1'000.00	30.11.2017	30.11.2020	37 357 527	%	97.700	94.230	100.000		0.000	Y
Structured Note on CS EAGLE Volatility Contr Exc	USD	1'000.00	03.12.2015	03.12.2020	30 112 483	%	114.500	92.550	100.000		0.000	Y
1/2 % Protection Participation on SMI-Index	USD	1'000.00	04.12.2015	04.12.2020	30 012 830	%	100.730	94.890	100.000	04.12.	4.910	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	04.12.2017	04.12.2020	38 487 155	CHF	930.750	94.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	06.12.2017	07.12.2020	38 487 174	%	99.300	94.180	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	08.12.2017	08.12.2020	37 357 528	%	99.200	94.070	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Total	EUR	1'000.00	08.12.2017	08.12.2020	38 487 074	CHF	1167.800	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on AXA	EUR	1'000.00	08.12.2017	08.12.2020	38 487 075	CHF	1150.840	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on S&P 500	USD	1.00	09.12.2014	09.12.2020	25 273 681	%	104.720	89.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 11.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.322%	USD	1.00	09.12.2014	09.12.2020	25 273 680		-	89.160	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	USD	1'000.00	09.06.2017	09.12.2020	36 454 196	CHF	1001.760	94.370	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	11.12.2015	11.12.2020	28 884 315	%	101.820	92.180	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	14.06.2017	14.12.2020	36 454 305	%	97.420	94.380	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	23.12.2015	17.12.2020	29 620 992	%	103.700	92.160	100.000		0.000	Y
Structured Note Credit Linked on Glencore International AG	CHF	1'000.00	01.12.2014	21.12.2020	25 273 734	%	101.450	100.000	100.000	22.12.	17.094	N
Structured Note on Equities	CHF	1'000.00	19.12.2014	21.12.2020	25 273 741	%	101.170	99.340	100.000	21.12.	1.000	Y
2.7 % Structured Note Credit Linked on Berkshire Hathawa	USD	1'000.00	11.12.2015	21.12.2020	30 112 521	%	96.950	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	6.727 6.587 6.492 6.646	N
Structured Note Credit Linked on Bank of India	USD	1'000.00	04.02.2016	21.12.2020	29 151 152	%	99.150	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	7.474 7.860 8.046 8.276	N
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	21.03.2017	21.12.2020	34 468 564	CHF	1406.520	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	USD	1'000.00	20.06.2017	21.12.2020	36 454 360	CHF	1004.680	94.170	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	23.12.2015	23.12.2020	30 485 067	%	103.700	91.960	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 28.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.267%	USD	1'000.00	28.12.2015	28.12.2020	30 485 073		-	92.090	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Crude Oil	USD	1'000.00	27.12.2017	28.12.2020	38 487 320	%	99.700	93.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	28.12.2017	28.12.2020	38 487 332	%	99.400	93.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	28.12.2017	28.12.2020	38 487 333	%	98.600	93.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	28.12.2017	28.12.2020	38 487 326	%	99.230	93.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	28.12.2017	28.12.2020	38 487 327	%	99.230	93.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	USD	1'000.00	30.06.2017	30.12.2020	36 454 362	CHF	1003.700	94.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 4.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.625%	EUR	1'000.00	04.01.2016	04.01.2021	30 485 078		-	98.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 4.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.482%	GBP	1'000.00	04.01.2017	04.01.2021	34 906 077		-	96.590	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 5.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.996%	USD	1'000.00	04.01.2017	04.01.2021	34 906 076		-	92.710	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	05.07.2017	05.01.2021	36 851 980	%	98.700	100.000	100.000	05.10.	0.000	N
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	11.01.2016	11.01.2021	30 485 088	CHF	1298.760	98.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 12.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.937%	USD	1'000.00	12.01.2016	12.01.2021	30 485 093		-	91.990	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 13.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.686%	EUR	1'000.00	13.01.2016	13.01.2021	30 485 097		-	98.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 14.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	14.01.2016	14.01.2021	30 485 113		-	92.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 17.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	15.01.2016	15.01.2021	30 485 121		-	92.390	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	15.01.2016	15.01.2021	30 012 870	%	107.220	92.770	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	17.01.2017	18.01.2021	34 468 465	%	101.500	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	21.01.2016	21.01.2021	30 485 158	CHF	1337.280	98.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 23.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.72%	EUR	1'000.00	21.01.2016	21.01.2021	30 485 163		-	98.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 23.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.733% 23.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	22.01.2016	22.01.2021	30 485 195		-	98.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 23.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.733%	EUR	1'000.00	22.01.2016	22.01.2021	30 485 193		-	98.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 23.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.723%	EUR	1'000.00	22.01.2016	22.01.2021	30 485 192		-	98.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 23.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	22.01.2016	22.01.2021	30 485 181		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 25.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.979%	USD	1'000.00	25.01.2016	25.01.2021	30 485 194		-	93.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 25.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.979%	USD	1'000.00	25.01.2016	25.01.2021	30 485 199		-	93.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 30.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.803%	USD	1'000.00	28.01.2016	28.01.2021	30 485 240		-	93.240	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Credit Suisse EAGLE	USD	1'000.00	28.01.2016	28.01.2021	30 112 528	%	111.750	93.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 30.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.779%	EUR	1'000.00	28.01.2016	28.01.2021	30 485 222		-	99.090	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI-Index	USD	1'000.00	29.01.2016	29.01.2021	29 621 013	%	107.200	93.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 30.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.066%	USD	1'000.00	29.01.2016	29.01.2021	30 485 228		-	93.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 30.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.832%	EUR	1'000.00	29.01.2016	29.01.2021	30 485 230		-	99.310	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 1.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.786%	USD	1'000.00	01.02.2016	01.02.2021	30 485 238		-	93.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 1.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.795%	USD	1'000.00	01.02.2016	01.02.2021	30 485 239		-	93.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on S&P 500 2.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.924%	USD	1'000.00	02.02.2016	02.02.2021	30 485 254		-	93.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 8.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.262%	GBP	1'000.00	08.02.2017	08.02.2021	34 906 449		-	96.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	09.02.2016	09.02.2021	30 485 274	CHF	809.780	93.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 10.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.448%	USD	1'000.00	10.02.2016	10.02.2021	30 485 276		-	93.950	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI-Index	USD	1'000.00	12.02.2016	12.02.2021	30 012 903	%	107.020	94.020	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	16.02.2016	16.02.2021	30 485 291	CHF	1456.070	99.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	18.02.2016	18.02.2021	30 485 298	%	104.090	99.740	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on CAC 40 20.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.937%	EUR	1'000.00	18.02.2016	18.02.2021	30 485 300		-	99.740	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 20.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.937%	EUR	1'000.00	18.02.2016	18.02.2021	30 485 299		-	99.740	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	USD	1'000.00	31.08.2017	26.02.2021	37 823 447	CHF	999.810	94.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 1.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.966%	EUR	1'000.00	01.03.2016	01.03.2021	30 485 339		-	99.860	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	02.03.2016	02.03.2021	30 012 935	%	111.800	94.820	100.000		0.000	Y
Protection Participation on CSEAGLETotRetIndUSD	USD	1'000.00	14.03.2016	15.03.2021	31 562 194	%	115.100	93.790	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI-Index	USD	1'000.00	16.03.2016	16.03.2021	30 012 962	%	110.000	93.790	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	18.03.2016	18.03.2021	30 485 412	CHF	1096.260	93.570	100.000		0.000	Y
Credit Linked Notes Credit Linked on HeidelbergCement	USD	1'000.00	14.03.2014	22.03.2021	22 593 763	%	101.150	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	7.717 7.933 8.111 8.431	N
Protection Participation on SMI	NOK	10'000.00	22.03.2016	22.03.2021	30 012 982	%	109.600	94.860	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	23.03.2017	23.03.2021	36 043 997	%	98.200	92.280	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf SMI-Index	USD	1'000.00	24.03.2016	24.03.2021	31 186 926	%	107.000	95.850	102.500		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 27.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.466%	USD	1'000.00	27.03.2017	29.03.2021	34 907 004		-	92.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 28.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.861%	USD	1'000.00	28.03.2017	29.03.2021	36 044 094		-	92.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 29.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.767%	GBP	1'000.00	29.03.2017	29.03.2021	36 044 109		-	96.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	USD	1'000.00	28.09.2017	29.03.2021	37 823 756	CHF	980.320	93.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	30.03.2017	30.03.2021	36 044 149	%	102.040	92.420	100.000		0.000	Y
(1 % p.a.) Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	04.04.2016	06.04.2021	31 562 235	%	107.940	100.000	100.000	04.04.		N
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	06.04.2016	06.04.2021	31 562 258	CHF	782.500	94.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 11.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	11.04.2017	12.04.2021	36 044 303		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	11.04.2017	12.04.2021	36 044 307	CHF	1162.000	99.770	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	20.04.2016	20.04.2021	30 013 018	%	108.480	94.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on FTSE 100 24.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.392%	GBP	1.00	24.04.2015	26.04.2021	26 574 153		-	91.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	24.04.2017	26.04.2021	36 044 442	%	101.000	93.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on S&P 500	USD	1.00	07.05.2015	07.05.2021	27 033 320	%	103.630	90.170	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	18.05.2016	18.05.2021	31 883 751	%	106.810	94.400	100.000		0.000	Y
Protection Participation on iShs MSCI Em Mk	USD	1'000.00	24.05.2016	24.05.2021	31 562 291	%	111.100	93.980	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
(1.65 % Min. - 6 % Max.) floating rate	USD	1'000.00	22.05.2014	25.05.2021	23 651 587	%	98.200	100.000	100.000	22.02. 22.05. 22.08. 22.11.	4.173 4.012 3.992 4.056	N
Protection Participation on Gold	USD	1'000.00	09.06.2016	09.06.2021	32 646 775	%	100.200	88.930	95.000		0.000	Y
Protection Participation on Gold	GBP	1'000.00	09.06.2016	09.06.2021	32 646 776	%	101.500	90.210	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	14.06.2017	14.06.2021	36 454 303	%	97.940	93.440	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Gold	USD	1'000.00	17.06.2016	17.06.2021	32 646 796	%	101.700	94.210	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on S&P 500	USD	1.00	23.06.2015	18.06.2021	27 033 376	%	102.660	88.670	100.000		0.000	Y
(no min.) Credit Linked Note floating rate note with credit risk	CHF	1'000.00	25.04.2014	21.06.2021	23 651 576	%	99.130	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	1.653 1.679 1.673 1.685	N
(1.65 % min. - 6 % max.) Floored Floater floating rate	USD	1'000.00	19.06.2014	21.06.2021	24 334 941	%	98.070	100.000	100.000	19.03. 19.06. 19.09. 19.12.	4.111 4.017 3.971 4.073	N
(1 % min. - 6 % max.) Capped Floored Floater floating rate	EUR	1'000.00	19.06.2014	21.06.2021	24 334 942	%	103.580	100.000	100.000	20.03. 19.06. 19.09. 19.12.	2.709 2.749 2.947 2.948	N
1.7 % Structured Note Credit Linked on Glencore International AG	CHF	1'000.00	05.06.2015	21.06.2021	28 012 797	%	102.210	100.000	100.000	20.06.	17.000	N
4 % Structured Note on Macy's Inc.	USD	1'000.00	03.06.2016	21.06.2021	32 646 778	%	97.590	100.000	100.000	20.06.	11.466	N
Reverse Convertible on Indices 22.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.358%	USD	1'000.00	22.06.2017	22.06.2021	36 454 383		-	93.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.07.2016	01.07.2021	32 219 370	%	102.000	94.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 3.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	01.07.2016	01.07.2021	32 219 369		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	07.07.2016	07.07.2021	32 219 401	CHF	767.880	95.240	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTXBnk EUR P	EUR	1'000.00	14.07.2016	14.07.2021	32 219 419	CHF	1907.340	100.000	100.000		0.000	Y
(1.65 % min. - 6 % max.) Capped Floored Floater floating rate	USD	1'000.00	17.07.2014	19.07.2021	24 334 961	%	98.350	100.000	100.000	17.01. 18.04. 17.07. 17.10.	2.068 4.119 3.972 4.042	N
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	21.07.2016	21.07.2021	32 219 435	CHF	1088.000	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	10.08.2017	10.08.2021	36 454 733	%	99.400	93.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Gold	USD	1'000.00	16.08.2016	16.08.2021	32 646 841	%	96.400	89.850	95.000		0.000	Y
(1.7 % min. - 6 % max.) Floored Floater floating rate	USD	1'000.00	21.08.2014	23.08.2021	24 334 974	%	98.220	100.000	100.000	21.02. 22.05. 21.08. 21.11.	4.290 4.134 4.081 4.217	N
(0.85 % min. - 4.5 % max.) Floored Floater floating rate	EUR	1'000.00	21.08.2014	23.08.2021	24 334 975	%	103.270	100.000	100.000	21.02. 22.05. 21.08. 21.11.	2.310 1.162 2.438 2.527	N
Reverse Convertible on S&P 500	USD	1.00	09.06.2015	26.08.2021	28 012 799	%	102.030	87.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 28.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.903%	USD	1'000.00	30.08.2016	30.08.2021	32 219 563		-	94.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	29.08.2017	30.08.2021	37 823 428	%	100.400	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 2.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.485%	USD	1'000.00	02.09.2016	02.09.2021	32 219 583		-	94.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	05.09.2017	06.09.2021	37 823 500	%	98.900	97.330	100.000		0.000	Y
Protection Participation	USD	1'000.00	15.09.2017	15.09.2021	37 357 507	%	94.300	93.550	100.000		0.000	Y
3 3/4 % Credit Linked Notes Credit Linked on Galp Energia SGPS	EUR	1'000.00	11.08.2014	20.09.2021	24 903 159	%	110.480	100.000	100.000	22.09.	43.728	N
(1 1/4 % min. - 3 % max.) Credit Linked-Notes Credit Linked on Carlsberg Brew. floating rate	CHF	1'000.00	11.09.2014	20.09.2021	25 273 676	%	102.650	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	3.125 3.125 3.125 3.125	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
2 % StructuredNote Credit Linked on Glencore Internat ional AG	CHF	1'000.00	17.09.2014	20.09.2021	24 903 174	%	102.510	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	5.000 5.000 5.000 5.000	N
Credit Linked Notes Credit Linked on Glencore International AG	USD	1'000.00	19.09.2014	20.09.2021	24 903 184	%	96.770	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	8.720 8.539 8.415 6.954	N
(1.2% - 3%) Credit Linked Notes Credit Linked Carlsberg on Breweries A/S	CHF	1'000.00	19.09.2014	20.09.2021	25 273 665	%	102.720	100.000	100.000	20.03. 19.06. 20.09. 20.12.	3.000 2.966 3.000 3.000	N
Reverse Convertible on Indices 20.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.657%	USD	1'000.00	20.09.2016	20.09.2021	32 219 661		-	94.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 21.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.708%	USD	1'000.00	21.09.2016	21.09.2021	32 219 672		-	94.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 21.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.338%	USD	1'000.00	21.09.2016	21.09.2021	32 219 662		-	94.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 22.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	22.09.2016	22.09.2021	32 219 677		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	USD	1'000.00	29.09.2017	29.09.2021	37 823 512	CHF	983.240	92.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 5.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.275%	USD	1'000.00	05.10.2016	05.10.2021	32 219 748		-	94.450	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	21.10.2016	21.10.2021	34 112 876	%	114.600	100.000	100.000		0.000	Y
Structured Note	USD	1'000.00	23.10.2014	25.10.2021	25 273 682	%	98.280	100.000	100.000	23.01. 24.04. 24.07. 23.10.	4.119 4.106 3.902 4.021	N
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 30.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	28.10.2016	28.10.2021	32 219 824		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 31.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	31.10.2016	29.10.2021	32 219 832		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	USD	1'000.00	02.11.2017	02.11.2021	38 486 859	CHF	965.700	92.240	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	USD	1'000.00	07.11.2017	08.11.2021	38 486 818	%	99.500	92.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 13.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.102%	USD	1'000.00	11.05.2017	12.11.2021	36 453 991		-	91.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 16.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.068%	USD	1'000.00	16.11.2016	16.11.2021	32 219 904		-	93.750	100.000		0.000	Y
(2.2 % - 3.4 %) Structured Note	USD	1'000.00	20.11.2014	22.11.2021	25 273 702	%	101.600	100.000	100.000	21.02. 22.05. 21.08. 20.11.	6.562 6.322 6.242 6.370	N
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	29.11.2017	29.11.2021	38 487 121	%	97.300	91.990	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	15.12.2016	15.12.2021	34 112 923	%	105.400	86.590	95.000		0.000	Y
Credit Linked Notes Credit Linked on HeidelbergCement	CHF	1'000.00	10.11.2014	20.12.2021	25 273 706	%	100.990	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	6.250 6.250 6.250 1.435	N
(1.2 % min. - 4 & max.) Structured Note Credit Linked on Compagnie de Saint-Gobain	CHF	1'000.00	12.12.2014	20.12.2021	25 273 731	%	102.370	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	3.000 3.000 3.000 3.000	N
Structured Note	USD	1'000.00	18.12.2014	20.12.2021	25 273 724	%	98.310	100.000	100.000	18.03. 19.06. 18.09. 18.12.	4.734 4.626 4.561 4.681	N
(2.2 % - 3.4 %) Structured Note	USD	1'000.00	19.12.2014	20.12.2021	25 273 725	%	101.400	100.000	100.000	20.03. 19.06. 19.12.	6.478 6.330 12.837	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Structured Note on 3 LafaHolcim 22	CHF	1'000.00	20.02.2017	20.12.2021	35 568 573	%	98.670	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	0.103 0.304 0.2985 0.310	N
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	30.06.2017	30.12.2021	36 454 458	%	102.110	92.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	17.07.2017	18.01.2022	36 454 506	%	101.880	91.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 20.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.633%	GBP	1'000.00	20.01.2017	20.01.2022	34 906 186		-	95.570	100.000		0.000	Y
Structured Note	USD	1'000.00	22.01.2015	24.01.2022	25 273 747	%	98.420	100.000	100.000	23.01. 24.04. 24.07. 22.10.	4.494 4.479 4.257 4.387	N
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 25.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.264%	USD	1'000.00	25.01.2017	25.01.2022	34 906 185		-	90.880	100.000		0.000	Y
Protection Participation on FTSE 100	GBP	1'000.00	27.01.2017	27.01.2022	34 112 950	%	100.000	95.150	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Chesapeake Energ Rg	USD	1'000.00	02.02.2017	02.02.2022	34 906 372	CHF	535.960	90.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	03.02.2017	03.02.2022	34 906 300	%	101.500	90.840	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	08.02.2017	08.02.2022	34 906 432	%	107.200	90.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	09.02.2017	09.02.2022	34 906 366	%	101.200	90.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	09.08.2017	09.02.2022	36 454 770	%	99.200	92.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 17.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.554%	USD	1'000.00	17.02.2016	17.02.2022	30 485 297		-	93.250	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	02.03.2017	02.03.2022	34 906 633	%	102.500	90.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	08.03.2017	08.03.2022	34 906 836	CHF	1003.320	90.690	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	09.03.2017	09.03.2022	34 906 846	CHF	1196.740	99.470	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	09.03.2017	09.03.2022	34 906 847	CHF	1196.180	99.470	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	09.03.2017	09.03.2022	34 906 855	CHF	1010.460	90.120	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	14.03.2017	14.03.2022	34 906 908	CHF	1011.310	90.040	100.000		0.000	Y
1.4 % Structured Note Credit Linked on Carlsberg Breweries	CHF	1'000.00	28.01.2015	21.03.2022	26 574 164	%	104.170	100.000	100.000	20.03.	14.000	N
(3.45 % min.) StructuredNote Credit Linked on Carlsberg Breweries A/S	USD	1'000.00	30.01.2015	21.03.2022	25 273 757	%	98.850	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	8.596 8.417 8.295 8.492	N
Structured Note Cr Lkd. on Glencore Intl AG floating rate	CHF	1'000.00	20.02.2015	21.03.2022	26 574 166	%	97.170	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	6.000 6.000 6.000 6.000	N
(4.65 % min.) Structured Note Credit Linked on Glencore International AG	USD	1'000.00	20.02.2015	21.03.2022	26 574 167	%	100.100	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	11.586 11.344 11.181 11.446	N
(2.55 % min.) Structured Note Credit Linked Berkshire Hathaway	USD	1'000.00	26.03.2015	21.03.2022	27 033 345	%	95.090	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	6.353 6.221 6.131 6.277	N
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	24.03.2017	24.03.2022	34 906 968	%	99.200	89.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	03.04.2017	04.04.2022	36 044 071	%	98.900	90.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	04.04.2017	04.04.2022	36 044 217	%	98.500	90.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	04.04.2017	04.04.2022	36 044 095	%	99.000	90.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	11.04.2017	11.04.2022	36 044 301	CHF	969.000	90.290	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	11.04.2017	11.04.2022	36 044 304	CHF	968.490	90.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	13.04.2017	13.04.2022	36 044 249	%	97.500	90.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	13.04.2017	13.04.2022	36 044 251	%	99.900	99.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 18.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.091%	EUR	1'000.00	18.04.2017	19.04.2022	36 044 359		-	99.200	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	18.04.2017	19.04.2022	36 044 392	CHF	981.250	90.770	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.10.2016	26.04.2022	32 219 846	%	47.200	93.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.10.2016	26.04.2022	32 219 847	%	44.200	93.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	26.04.2017	26.04.2022	36 044 470	%	99.200	96.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	26.04.2017	26.04.2022	36 044 464	%	99.900	96.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.10.2016	27.04.2022	34 112 885	%	43.400	93.140	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	28.04.2017	28.04.2022	36 453 881	%	105.420	99.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	08.05.2017	09.05.2022	36 453 936	%	97.700	90.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 13.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.923%	USD	1'000.00	12.05.2017	12.05.2022	36 454 016		-	90.620	100.000		0.000	Y
(1.85 % - 3.05 %) Structured Notes step up	USD	1'000.00	22.05.2015	23.05.2022	27 033 398	%	99.830	100.000	100.000	22.05. 22.11.	9.970 11.062	N
Reverse Convertible on Indices 24.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.27%	USD	1'000.00	23.05.2017	23.05.2022	36 454 129		-	91.020	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Gazprom Sp ADR	USD	1'000.00	24.05.2017	24.05.2022	36 454 140	CHF	1022.220	91.380	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Gazprom Sp ADR	USD	1'000.00	24.05.2017	24.05.2022	36 454 139	CHF	1022.220	91.380	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	30.05.2017	31.05.2022	36 454 175	CHF	1055.590	91.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	06.06.2017	06.06.2022	36 454 198	%	96.600	91.200	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur Gr N	CHF	1'000.00	07.06.2017	07.06.2022	36 454 211	CHF	996.000	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	07.06.2017	07.06.2022	36 454 199	%	97.600	98.960	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	08.06.2017	08.06.2022	36 454 220	CHF	894.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	13.06.2017	13.06.2022	36 454 292	CHF	1046.000	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	13.06.2017	13.06.2022	36 454 298	%	98.170	99.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1.00	15.06.2016	15.06.2022	32 646 790	%	103.400	99.340	100.000	15.12.	0.03127	Y
(min. 2 3/4 %) Structured Note Credit Linked on Berkshire Hathaway Inc.	USD	1'000.00	22.04.2015	20.06.2022	27 033 389	%	95.130	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	6.851 6.709 6.612 6.769	N
(2.65 % min) Structured Note Credit Linked on Berkshire Hathaway float. rate	USD	1'000.00	24.04.2015	20.06.2022	27 033 384	%	94.850	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	6.602 6.465 6.372 6.523	N
3.6 % Structured Note Credit Linked on Enel S.p.A.	USD	1'000.00	29.05.2015	20.06.2022	28 012 777	%	98.550	100.000	100.000	20.06.	35.132	N
(2.7 % min.) Structured Note Cr Lkd. on Berkshire Hathaway floating rate	USD	1'000.00	19.06.2015	20.06.2022	28 012 800	%	94.960	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	6.727 6.587 6.492 6.646	N
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	20.06.2017	20.06.2022	36 454 348	CHF	925.910	91.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	20.06.2017	20.06.2022	36 454 299	%	97.300	91.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	21.06.2017	21.06.2022	36 454 363	%	100.310	99.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	22.06.2017	22.06.2022	36 454 380	%	98.070	99.270	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	23.06.2017	23.06.2022	36 454 384	CHF	921.030	91.240	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	23.06.2017	23.06.2022	36 454 386	CHF	935.000	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	27.06.2017	27.06.2022	36 454 354	%	97.600	91.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	03.07.2017	04.07.2022	36 454 403	%	97.700	99.250	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	03.07.2017	04.07.2022	36 454 402	%	97.700	99.250	100.000		0.000	Y
(2.2 % - 3.4 %) Structured Notes step up	USD	1'000.00	03.07.2015	05.07.2022	28 012 814	%	101.870	100.000	100.000	03.01. 03.07.	12.347 11.557	N
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	03.07.2017	05.07.2022	36 454 401	%	97.300	91.190	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	05.07.2017	05.07.2022	36 454 447	CHF	916.980	91.240	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Swiss Re N	CHF	1'000.00	11.07.2017	11.07.2022	36 454 519	CHF	976.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	17.07.2017	18.07.2022	36 454 555	CHF	928.920	90.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	18.07.2017	18.07.2022	36 454 582	%	99.200	90.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 19.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.787% 19.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	19.07.2017	19.07.2022	36 454 592		-	90.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	26.07.2017	26.07.2022	36 454 667	%	99.500	91.060	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	26.07.2017	26.07.2022	36 454 654	CHF	1111.090	98.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	26.07.2017	26.07.2022	36 454 662	%	100.300	91.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	31.07.2017	29.07.2022	36 454 686	%	100.300	91.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	16.08.2017	16.08.2022	36 454 814	%	99.500	91.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	18.08.2017	18.08.2022	36 454 835	%	98.520	91.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 29.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.373%	USD	1'000.00	29.08.2016	29.08.2022	33 162 688		-	93.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	31.08.2017	31.08.2022	37 823 464	%	99.300	91.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	04.09.2017	05.09.2022	37 823 420	%	99.000	96.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	06.09.2017	06.09.2022	37 823 501	%	99.620	91.720	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	13.09.2017	13.09.2022	37 823 570	%	99.970	99.310	100.000		0.000	Y
(min. 2 %) Structured Note floating rate note	USD	1'000.00	18.09.2015	19.09.2022	28 845 408	%	98.100	100.000	100.000	20.03. 19.06. 18.09. 18.12.	4.983 4.869 4.801 4.927	N
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	21.09.2017	21.09.2022	37 823 590	%	98.400	91.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	03.10.2017	03.10.2022	37 823 791	CHF	1085.450	98.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	04.10.2017	04.10.2022	37 823 825	%	99.000	90.620	100.000		0.000	Y
Protection Participation on CS Managed Multi-Asset TR Ix	USD	1'000.00	06.10.2016	06.10.2022	32 646 858	%	103.580	92.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	11.10.2017	11.10.2022	37 823 797	%	99.800	90.880	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	CHF	1'000.00	12.10.2017	12.10.2022	38 486 591	CHF	928.100	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	25.10.2017	25.10.2022	38 486 750	%	99.600	90.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	26.10.2017	26.10.2022	38 486 761	%	96.340	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	07.11.2017	07.11.2022	38 486 890	%	93.380	99.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	08.11.2017	08.11.2022	38 486 910	%	98.300	94.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	10.11.2017	10.11.2022	38 486 926	%	95.590	99.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	13.11.2017	14.11.2022	38 486 940	%	97.500	90.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	16.11.2017	16.11.2022	38 486 988	%	94.500	99.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	21.11.2017	21.11.2022	38 486 956	%	95.500	95.030	100.000		0.000	Y
Protection Participation on CS Managed Multi-Asset TR In	USD	1'000.00	22.11.2016	22.11.2022	32 646 855	%	105.250	89.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	22.11.2017	22.11.2022	38 487 066	%	99.400	90.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	22.11.2017	22.11.2022	38 487 073	%	98.300	90.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	28.11.2017	28.11.2022	38 487 099	%	99.300	90.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	05.12.2017	05.12.2022	38 487 173	%	97.800	90.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	16.12.2017	06.12.2022	38 487 175	%	98.100	89.910	100.000		0.000	Y
0 % Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 12.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	12.12.2016	12.12.2022	34 468 407		-	98.570	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	11.12.2017	12.12.2022	39 169 688	%	99.300	99.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	13.12.2017	13.12.2022	38 487 235	%	98.500	89.730	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 9.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.04.2017	11.04.2023	35 765 765		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 27.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	26.05.2017	26.05.2023	35 765 859		-	100.000	100.000		0.000	Y
3.6 % Structured Note on Tesco	EUR	10'000.00	09.06.2016	20.06.2023	32 646 795	%	110.710	100.000	100.000	20.06.	402.85	N
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	13.07.2017	13.07.2023	36 454 417	%	101.200	93.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	11.08.2017	11.08.2023	36 454 767	%	99.700	88.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	16.08.2017	16.08.2023	36 852 089	%	102.610	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	03.10.2017	03.10.2023	37 823 779	%	98.200	88.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	07.12.2017	07.12.2023	38 487 179	%	99.800	93.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	08.12.2017	08.12.2023	38 487 189	%	99.600	87.660	100.000		0.000	Y
Structured Note on CS Group N	USD	1'000.00	22.12.2016	22.12.2023	34 112 915	%	100.130	100.000	100.000	22.06. 22.12.	11.423 11.630	N
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	28.12.2017	28.12.2023	38 487 321	%	98.600	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Roche Hldg G	USD	1'000.00	16.06.2017	17.06.2024	36 454 333	%	91.100	86.930	100.000		0.000	Y
2.55 % Structured Note on Telecom Italia S.p.A.	EUR	1'000.00	03.05.2017	20.06.2024	35 568 621	%	101.400	100.000	100.000	20.06.	0.62979	N
Credit Suisse International, London, Grossbritannien												
Bonus Certificates on Equities	USD	1'000.00	13.02.2014	13.02.2017	20 540 937		-	97.490	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	13.06.2014	13.06.2017	20 681 381		-	97.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.23%	USD	1'000.00	11.06.2015	18.06.2018	20 681 399		-	96.430	100.000		0.000	Y
ProNote on PB Hedge Fund Advisory Fund	USD	100'000.00	24.02.2015	13.03.2019	25 775 423	%	96.420	94.480	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Funds	USD	1'000.00	15.05.2013	15.05.2019	20 681 336	CHF	894.560	93.370	100.000		0.000	Y
ProNote on CS RAII HOLT Relative Idx	USD	1'000.00	17.04.2014	17.10.2019	23 717 913	%	98.000	90.410	100.000		0.000	Y
ProNote on PB Hedge Fund	USD	1'000'000.00	21.11.2014	10.01.2020	23 717 928	%	99.000	89.050	100.000		0.000	Y
ProNote on PB Hedge Fund	USD	1'000'000.00	24.01.2014	28.02.2020	20 473 161	%	102.260	88.330	100.000		0.000	Y
ProNote on PB Hedge Fund Advisory Fund	USD	100'000.00	23.02.2015	13.03.2020	25 775 422	%	95.220	87.320	95.000		0.000	Y
ProNote on Credit Suisse Systematic Index	USD	1'000.00	22.04.2015	22.04.2020	25 775 433	%	98.220	92.790	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig.		Zinsen / Intérêts / Interessi 2017		IUP
								Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	
Certificate on Class I1 AHL Global Futures 6 EUR Ref Ent 27.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.028%	EUR	1.00	20.01.2011	29.01.2024	10 912 102		-	62.950	100.000		0.000	Y
(no min.) Euro Medium-Term Notes FRN on Equity	EUR	1'000.00	16.06.2011	03.01.2025	11 523 474	%	113.330	61.570	100.000		0.000	Y
Protection Participation on CS STAA 6% CHF ER	CHF	100.00	13.04.2017	13.04.2027	33 300 864	%	100.370	89.390	90.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
DBS Bank Ltd, Singapore, Singapur												
Express Certificate VRN on Chicago Bdge NY Reg Shs	USD	1'000.00	13.07.2015	13.01.2017	28 843 379		-	99.000	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on China Vanke Co Ltd Shs	HKD	100'000.00	13.02.2015	03.02.2017	27 101 018		-	98.420	100.000		0.000	Y
BONUS PARTICIPATION EQUITY LINKED NOTES on Pico Far East Holdings Ltd Shs	CHF	1'000.00	19.03.2015	10.03.2017	27 512 283		-	100.000	100.000		0.000	Y
6.44 % Multi Reverse Convertible on a Basket of ADR and Shs 15.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	20.03.2015	20.03.2017	27 491 835		-	100.000	100.000	15.03.	4.708	N
Equity Linked Notes on a Basket of Shs	SGD	1'000.00	23.04.2015	13.04.2017	27 942 332		-	97.680	100.000		0.000	Y
4.2425 % (16.97 % P.A.) Express Certificate on Tidewater Inc Shs	USD	1'000.00	01.06.2015	19.05.2017	28 369 027		-	98.390	100.000		0.000	Y
3.54 % (7.18 % P.A.) Autocallable Notes on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	22.05.2015	22.05.2017	28 272 337		-	100.000	100.000	22.05.	0.000	N
Express Certificate on a Basket of Shs	GBP	1'000.00	30.06.2015	22.06.2017	28 711 219		-	97.860	100.000		0.000	Y
DekaBank Deutsche Girozentrale, Frankfurt a.M., Deutschland												
Memory Express-Zert. auf Aktien-Basket	EUR	100.00	25.02.2015	25.02.2020	27 243 145	CHF	122.990	98.674	100.000		0.000	N
(2 % - 2.65 %) Bonitaetsanl. Serie R1096 Stufenzins	EUR	1'000.00	30.04.2014	25.03.2021	24 452 454	%	106.220	100.000	100.000	25.03.	22.477	N
Bonitaetsanl. S R3120 mit kreditrisiko auf Allianz SE var.	EUR	1'000.00	29.07.2015	11.10.2022	29 034 518	%	100.050	100.000	100.000	12.01. 11.04. 11.07. 11.10.	0.73004 0.66302 0.67456 0.70262	N
1.72 % Bonitaetsanl. SR1913 mit Kreditrisiko auf Merck	EUR	1'000.00	19.11.2014	23.12.2022	26 088 008	%	104.450	100.000	100.000	23.12.	20.195	N
(2 % - 4 %) Bonitaetsanl. mit Kreditrisiko auf Volkswagen Staffelzins	EUR	1'000.00	12.03.2014	25.03.2024	24 423 828	%	111.190	100.000	100.000	25.03.	21.407	N
Deutsche Bank AG, Frankfurt am Main, Deutschland												
10 % Issuer Callable BRC on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	05.11.2015	08.05.2017	28 204 254		-	100.000	100.000	06.02. 08.05.	0.000 0.000	N
8.2 % Protect Aktienanl. auf Aktien-Basket	CHF	1'000.00	20.05.2015	18.05.2017	14 188 102		-	100.000	100.000	17.02. 18.05.	0.000 0.000	N
4 % Protect-Aktienanl. auf Euro Stoxx 50-Index	CHF	1'000.00	16.06.2015	16.06.2017	14 188 106		-	100.000	100.000	16.03. 16.06.	0.000 0.000	N
Capped Bonus-Zert. auf Euro Stoxx 50-Index	EUR	0.000	25.06.2015	21.06.2017	28 671 019		-	99.753	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on ThyssenKrupp	EUR	1'000.00	21.09.2016	21.09.2017	33 814 380		-	100.000	100.000	21.09.	0.000	Y
Capital Protected Note auf Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	05.05.2015	02.05.2018	14 188 092	%	93.490	96.935	100.000		0.000	Y
3 % Protect-Aktienanleihe auf Aktien-Basket	CHF	1'000.00	11.05.2015	11.05.2018	26 684 777	%	102.770	100.000	100.000	11.05.	0.000	N
3 % Protect-Aktienanl. auf Aktien-Basket	CHF	1'000.00	29.05.2015	29.05.2018	14 188 101	%	85.180	100.000	100.000	29.05.	0.000	N
2 % Indexanl. auf Euro Stoxx 50-Index 6.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	05.06.2015	05.06.2018	14 188 103		-	100.000	100.000	08.03. 06.06. 05.09. 06.12.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
4 % Protect-Aktienanl. (28.8.18) auf Aktien-Basket	CHF	1'000.00	06.03.2015	04.09.2018	14 188 062	%	99.390	100.000	100.000	06.03.	0.000	N
3 % Barrier Reverse Convertible auf Aktien-Basket	CHF	1'000.00	18.09.2015	18.09.2018	14 188 148	%	100.500	100.000	100.000		0.000	N
3 % Worst-Of Barrier Reverse Convertible on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	30.09.2015	01.10.2018	14 188 156	%	102.510	100.000	100.000	02.10.	0.000	N
2.4 % Reverse Convertible auf Euro Stoxx 50	EUR	100.00	14.04.2016	15.04.2019	32 070 494	CHF	120.640	100.000	100.000	18.04.	0.000	N
2.25 % Reverse Convertible auf Euro Stoxx 50	EUR	100.00	02.06.2016	03.06.2019	32 621 672	CHF	119.970	100.000	100.000	02.06.	0.000	N
(ohne Min.) Phoenix Note auf Index-Basket	USD	1'000.00	31.07.2015	31.07.2019	14 188 146	%	103.460	94.010	100.000		0.000	Y
Phoenix Notes auf Index-Basket	USD	1'000.00	31.07.2015	31.07.2019	14 188 143	%	103.150	94.058	100.000		0.000	Y
Kapitalschutz-Zert. auf Nikkei 225-Index	EUR	100.00	20.08.2015	20.08.2020	29 208 415	CHF	127.270	98.248	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Capped Kapitalschutz-Zert. on Euro Stoxx 50-Index	EUR	100.00	06.08.2015	06.08.2021	29 060 372	CHF	119.190	96.819	100.000		0.000	Y
Deutsche Bank AG, London Branch, London, Grossbritannien												
7.03 % Worst-Of Barrier Reverse Convertible on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	11.01.2016	11.01.2017	28 204 450		-	100.000	100.000		0.000	Y
2.83 % Worst-Of Barrier Reverse Convertible on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	20.01.2015	27.01.2017	26 096 750		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
8.66 % Worst-Of Barrier Reverse Convertible on a Basket of Indices	EUR	1'000.00	13.01.2016	27.01.2017	28 204 452		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
6.95 % Worst-Of Barrier Reverse Convertible on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	15.01.2016	27.01.2017	28 204 456		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
3.27 % Barrier Reverse Convertible on Reckitt Benckiser Grp Plc Shs	GBP	1'000.00	21.01.2016	27.01.2017	28 204 459		-	100.000	100.000	27.01.	13.160	Y
9.05 % Worst-Of Barrier Reverse Convertible on a Basket of Indices	EUR	1'000.00	22.01.2016	27.01.2017	28 204 461		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
5.14 % Reverse Convertible on BT Group Sp ADR	GBP	1'000.00	06.07.2016	27.01.2017	31 773 879		-	100.000	100.000	27.01.	4.910	Y
8.98 % Reverse Convertible on Renault	EUR	1'000.00	06.07.2016	27.01.2017	31 773 876		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
8.41 % Worst-Of Barrier Reverse Convertible on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	01.02.2016	01.02.2017	28 204 470		-	100.000	100.000	01.02.	0.210	Y
Worst-Of Autocall Note VRN on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	11.08.2015	13.02.2017	28 204 148		-	99.885	100.000		0.000	Y
11 % Worst-Of Barrier Reverse Convertible on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	17.02.2016	24.02.2017	28 204 477		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
7.48 % Barrier Reverse Convertible on Fresenius SE & Co KGaA Shs	EUR	1'000.00	01.03.2016	24.02.2017	28 204 483		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
12.57 % Worst-Of Barrier Reverse Convertible on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	01.03.2016	24.02.2017	28 204 482		-	100.000	100.000	24.02.	0.000	Y
11.97 % Worst-Of Barrier Reverse Convertible on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	17.03.2016	17.03.2017	28 204 494		-	100.000	100.000	17.03.	0.000	Y
8.3 % Worst-Of Barrier Reverse Convertible on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	07.03.2016	24.03.2017	28 204 489		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
4.44 % Barrier Reverse Convertible on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	22.03.2016	24.03.2017	28 204 338		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
8.87 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.07.2016	24.03.2017	31 773 886		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
9.59 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.07.2016	24.03.2017	31 773 885		-	100.000	100.000	24.03.	0.000	Y
Autocall Note VRN on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	09.04.2015	10.04.2017	26 684 721		-	98.303	100.000		0.000	Y
11.22 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.04.2016	10.04.2017	28 204 357		-	100.000	100.000	10.04.	0.000	Y
12 1/4 % Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	08.04.2016	10.04.2017	28 204 354		-	100.000	100.000	10.04.	0.000	Y
9 1/2 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.04.2016	12.04.2017	31 773 810		-	100.000	100.000	12.04.	12.100	Y
Autocall Note VRN on Basket of Indicies	USD	1'000.00	14.04.2015	18.04.2017	26 684 724		-	98.389	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Euro Stoxx 50	EUR	1'000.00	19.04.2016	21.04.2017	31 773 813		-	100.000	100.000		0.000	Y
4 3/4 % Worst-Of Barrier Reverse Convertible on Basket of Shs	CHF	10'000.00	24.04.2015	28.04.2017	26 684 786		-	100.000	100.000	28.04.	0.000	Y
10.2 % (20.4 % P.A.) Worst-Of Autocall Note on a Basket of Shs	EUR	1'000.00	30.04.2015	28.04.2017	26 684 771		-	99.880	100.000		0.000	Y
Twin Win Autocallable Note on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1.00	07.05.2015	08.05.2017	26 684 732		-	99.882	100.000		0.000	Y
Airbag Certificate on a Basket of Shs	EUR	100.00	15.05.2015	16.05.2017	26 684 820		-	99.843	100.000		0.000	Y
6.37 % Reverse Convertible on Air France - KLM	USD	1'000.00	24.05.2016	24.05.2017	31 773 837		-	100.000	100.000	24.05.	12.130	Y
6.24 % Reverse Convertible on Air France - KLM	USD	1'000.00	24.05.2016	24.05.2017	31 773 836		-	100.000	100.000	24.05.	12.130	Y
8.04 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.05.2016	26.05.2017	31 773 834		-	100.000	100.000	26.05.	0.000	Y
6.24 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.05.2016	29.05.2017	31 773 839		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
5.28 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.05.2016	29.05.2017	31 773 838		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
7.6 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.11.2016	29.05.2017	31 773 965		-	100.000	100.000	29.05.	0.000	Y
AutoCallable Note on USD/CNH Excahange Rate	CNH	1'000'000.00	28.05.2015	31.05.2017	26 684 858		-	93.861	100.000		0.000	Y
5.68 % Barrier Reverse on Vivendi	CHF	1'000.00	16.06.2016	16.06.2017	31 773 859		-	100.000	100.000	16.06.	0.000	Y
2.6 % Credit Linked Notes Cr Lkd on Holcim Finance S.A Reference Entity	CHF	10'000.00	15.06.2012	20.06.2017	18 587 958		-	100.000	100.000	20.03. 20.06.	65.000 65.000	N
1 % (4 % P.A.) Barrier Reverse Convertible on a Basket of Indices 17.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	17.06.2015	20.06.2017	28 204 004		-	100.000	100.000	17.03.	0.000	N
4 % Reverse Convertible on The Swatch Grp	CHF	1'000.00	22.06.2016	23.06.2017	31 773 865		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y
8.74 % Reverse Convertible on Syngenta N	CHF	1'000.00	14.12.2016	23.06.2017	31 774 003		-	100.000	100.000	23.06.	0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
22 % Reverse Convertible on Equities Called for red.on 24.03.17 at 100%	CHF	1'000.00	24.06.2016	26.06.2017	31 774 200		-	100.000	100.000			N
24.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung										24.03.	0.000	
24.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung										24.03.	0.000	
5.13 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.06.2016	27.06.2017	31 773 869		-	100.000	100.000	27.06.	0.000	Y
7.63 % Reverse Convertible on Airbus Group	USD	1'000.00	08.07.2016	10.07.2017	31 773 882		-	100.000	100.000	10.07.	11.950	Y
11.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.01.2017	10.07.2017	31 774 047		-	100.000	100.000	10.07.	0.000	Y
CP Note on a Basket of Currencies	USD	100'000.00	24.07.2015	24.07.2017	28 204 105		-	98.327	100.000		0.000	Y
Capital Protected Note on USD/CNH Exchange Rate	USD	100'000.00	24.07.2015	24.07.2017	28 204 106		-	98.327	100.000		0.000	Y
4.15 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.07.2016	28.07.2017	31 773 878		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
2.23 % Reverse Convertible on Muench Rueckvers	EUR	1'000.00	14.07.2016	28.07.2017	31 773 887		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
4 1/4 % (pro rata) on Equities	EUR	1'000.00	30.11.2016	28.07.2017	31 773 981		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
23.36 % Reverse Convertible on Actelion N	CHF	1'000.00	28.12.2016	28.07.2017	31 774 023		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
8.1 % Reverse Convertible on Linde	EUR	1'000.00	02.01.2017	28.07.2017	31 774 035		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
9.27 % Reverse Convertible on HeidelbergCement	EUR	1'000.00	02.01.2017	28.07.2017	31 774 036		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
4.19 % Reverse Convertible on Syngenta N	CHF	1'000.00	11.01.2017	28.07.2017	31 774 063		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
2 1/2 % Reverse Convertible on CMS Rt USD 10Y	CHF	1'000.00	03.08.2016	03.08.2017	32 013 920		-	100.000	100.000	03.08.	0.000	Y
Lookback Certificate on Euro Stoxx 50 Index Senior	USD	100.00	13.08.2014	11.08.2017	24 938 788		-	96.624	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on Euro Stoxx 50 Index Senior	EUR	3'410.00	18.02.2015	18.08.2017	26 684 603		-	99.599	100.000		0.000	Y
3.68 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.03.2017	21.08.2017	31 774 183		-	100.000	100.000		0.000	Y
8.18 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.02.2017	24.08.2017	31 774 144		-	100.000	100.000	24.08.	0.000	Y
7.68 % Reverse Convertible on	EUR	1'000.00	17.02.2017	24.08.2017	31 774 149		-	100.000	100.000	24.08.	0.000	Y
3.92 % Worst-Of Barrier on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	06.08.2015	25.08.2017	28 204 152		-	100.000	100.000		0.000	Y
5.99 % Worst-Of Barrier Reverse Convertible on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	25.08.2015	25.08.2017	28 204 163		-	100.000	100.000		0.000	Y
8.55 % Reverse Convertible on Renault	EUR	1'000.00	06.02.2017	25.08.2017	31 774 112		-	100.000	100.000	25.08.	0.000	Y
11.15 % Reverse Convertible on BHP Billiton	GBP	1'000.00	06.02.2017	25.08.2017	31 774 113		-	100.000	100.000	25.08.	3.700	Y
9.62 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	16.01.2017	31.08.2017	31 774 073		-	100.000	100.000	31.08.	4.590	Y
1.16 % (4.64 % P.A.) Phoenix Autocallable Note on a Basket of Indices	CHF	1'000.00	03.09.2015	05.09.2017	28 204 302		-	100.000	100.000	06.03.	0.000	N
6.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung										06.06.	0.000	
Express Note (Phoenix Autocall) VRN on a Basket of Indices & Fund Sr	USD	1'000.00	17.09.2014	15.09.2017	24 701 719		-	96.560	100.000		0.000	Y
4.97 % Reverse Convertible on Sanofi	EUR	1'000.00	16.09.2016	18.09.2017	31 773 926		-	100.000	100.000	18.09.	0.000	Y
10.8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.09.2016	19.09.2017	31 773 960		-	100.000	100.000			N
13.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung										13.03.	0.000	
4.49 % Worst-Of Barrier Reverse Convertible on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	02.03.2016	22.09.2017	28 204 484		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
3.57 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	09.06.2016	22.09.2017	31 773 855		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
6.29 % Reverse Convertible on Pearson	GBP	1'000.00	22.09.2016	22.09.2017	31 773 929		-	100.000	100.000	22.09.	9.890	Y
4.81 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.01.2017	22.09.2017	31 774 057		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
3.6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	14.03.2017	22.09.2017	31 774 214		-	100.000	100.000	22.09.	0.000	Y
4.24 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.03.2016	25.09.2017	28 204 340		-	100.000	100.000	25.09.	0.000	Y
Express Certificate on a Basket of Shs	CHF	0.000	25.09.2014	27.09.2017	24 938 848		-	99.811	100.000		0.000	Y
Worst-Of Barrier Reverse Convertible VRN on a Bskt of Indices	USD	1'000.00	27.03.2015	27.09.2017	26 684 689		-	97.240	100.000		0.000	Y
Capital Protected Note on a Basket of Indices	USD	1'000.00	01.04.2015	02.10.2017	27 154 226		-	92.763	95.000		0.000	Y
Autocall Note VRN on Halliburton Co Shs Sr	USD	1'000.00	24.10.2014	17.10.2017	24 938 925		-	96.940	100.000		0.000	Y
17.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
3/4 % (3 % P.A.) Phoenix Autocallable Note on a Basket of Indices	CHF	1'000.00	27.10.2015	20.10.2017	28 204 249		-	100.000	100.000	23.01.	0.000	N
										24.04.	0.000	
20.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung										20.07.	0.000	
5.18 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.03.2017	27.10.2017	31 774 245		-	100.000	100.000	27.10.	8.730	Y
6.32 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	29.03.2017	27.10.2017	31 774 256		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
8.21 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	29.03.2017	27.10.2017	31 774 257		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
7.27 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	29.03.2017	27.10.2017	31 774 253		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
4.58 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.04.2017	27.10.2017	31 774 286		-	100.000	100.000	27.10.	7.990	Y
6.45 % Reverse Convertible on Engie Sp ADR	EUR	1'000.00	26.04.2017	27.10.2017	36 437 906		-	100.000	100.000	27.10.	0.000	Y
7.57 % Reverse Convertible on Electricite DE	EUR	1'000.00	15.03.2017	15.11.2017	31 774 218		-	100.000	100.000	15.11.	0.000	Y
4.58 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.08.2016	24.11.2017	31 773 898		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
1.98 % Reverse Convertible on Linde	EUR	1'000.00	17.11.2016	24.11.2017	31 773 961		-	100.000	100.000		0.000	Y
4.07 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.11.2016	24.11.2017	31 773 962		-	100.000	100.000		0.000	Y
6.21 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	21.11.2016	24.11.2017	31 773 964		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
7.16 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.11.2016	24.11.2017	31 773 974		-	100.000	100.000		0.000	Y
6.04 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.11.2016	24.11.2017	31 773 968		-	100.000	100.000	24.11.	0.000	Y
5.31 % Reverse Convertible on Valeo	EUR	1'000.00	02.05.2017	24.11.2017	36 437 911		-	100.000	100.000		0.000	Y
15.51 % Reverse Convertible on Banco Popular Espanol SA	EUR	1'000.00	09.05.2017	24.11.2017	36 437 927		-	100.000	100.000		0.000	Y
3.05 % Reverse Convertible on Nestle N	CHF	1'000.00	17.11.2016	07.12.2017	31 773 953		-	100.000	100.000		0.000	Y
7.03 % Reverse Convertible on Tullow Oil	USD	1'000.00	06.06.2017	07.12.2017	36 437 853		-	100.000	100.000	07.12.	6.450	Y
5.37 % Reverse Convertible on BHP Billiton	USD	1'000.00	06.06.2017	07.12.2017	36 437 854		-	100.000	100.000	07.12.	6.450	Y
6.63 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	21.12.2016	22.12.2017	31 774 013		-	100.000	100.000		0.000	Y
2.87 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.12.2016	22.12.2017	31 774 015		-	100.000	100.000		0.000	Y
5.02 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	28.12.2016	22.12.2017	31 774 020		-	100.000	100.000		0.000	Y
4.29 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.01.2017	22.12.2017	31 774 062		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
4.84 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.03.2017	22.12.2017	31 774 196		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
9.38 % Reverse Convertible on	CHF	1'000.00	16.03.2017	22.12.2017	31 774 224		-	100.000	100.000		0.000	Y
8.26 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	12.04.2017	22.12.2017	31 774 289		-	100.000	100.000		0.000	Y
13.78 % Reverse Convertible on Gemalto	EUR	1'000.00	13.06.2017	22.12.2017	36 437 862		-	100.000	100.000	22.12.	0.000	Y
7.84 % Reverse Convertible on Syngenta	CHF	1'000.00	28.12.2016	29.12.2017	31 774 017		-	100.000	100.000	29.12.	0.000	Y
Worst-Of Autocall Note VRN on a Bskt of Indices Senior	CHF	1'000.00	30.12.2014	30.12.2017	26 096 717		-	100.000	100.000	28.03. 28.06.	0.000 0.000	N
28.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
10.56 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	04.01.2017	04.01.2018	31 774 040	%	109.450	100.000	100.000		0.000	Y
4.69 % Reverse Convertible on	EUR	1'000.00	11.01.2017	17.01.2018	31 774 054	%	103.790	100.000	100.000		0.000	Y
5.06 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.01.2017	22.01.2018	31 774 056	%	104.240	100.000	100.000		0.000	Y
9.92 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	03.01.2017	26.01.2018	31 774 028	%	109.430	100.000	100.000		0.000	Y
7.01 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	03.01.2017	26.01.2018	31 774 027	%	106.390	100.000	100.000		0.000	Y
3.97 % Reverse Convertible on Henkel Vz	EUR	1'000.00	05.01.2017	26.01.2018	31 774 046	%	103.230	100.000	100.000		0.000	Y
6.68 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.01.2017	26.01.2018	31 774 049	%	105.780	100.000	100.000		0.000	Y
6.09 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.01.2017	26.01.2018	31 774 064	%	105.370	100.000	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible 2017-26.01.2018 on Equities	EUR	1'000.00	17.01.2017	26.01.2018	31 774 079	%	102.100	100.000	100.000		0.000	Y
7.53 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.01.2017	26.01.2018	31 774 086	%	106.750	100.000	100.000		0.000	Y
3.96 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.01.2017	26.01.2018	31 774 088	%	103.090	100.000	100.000		0.000	Y
7.45 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	20.01.2017	26.01.2018	31 774 087	%	106.510	100.000	100.000		0.000	Y
8.2 % Reverse Convertible 2017-28.01.18 on Equities	CHF	5'000.00	27.01.2017	26.01.2018	31 774 098	%	107.240	100.000	100.000		0.000	Y
2.3625 % (9.45 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.08.2016	05.02.2018	31 773 903		-	100.000	100.000	06.02. 08.05.	0.000 0.000	N
8.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
3.1 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.02.2017	20.02.2018	31 774 152	%	102.210	100.000	100.000		0.000	Y
8.04 % Reverse Convertible on AXA P	CHF	1'000.00	22.02.2017	22.02.2018	31 774 154	%	107.340	100.000	100.000		0.000	Y
6.84 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.08.2016	23.02.2018	31 773 905	%	109.540	100.000	100.000		0.000	Y
6.37 % Reverse Convertible on Adecco Group N	CHF	1'000.00	01.02.2017	23.02.2018	31 774 102	%	105.610	100.000	100.000		0.000	Y
7.32 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	02.02.2017	23.02.2018	31 774 104	%	106.790	100.000	100.000		0.000	Y
5.66 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.02.2017	23.02.2018	31 774 110	%	105.050	100.000	100.000		0.000	Y
3.26 % Reverse Convertible on Equities	CHF	100'000.00	07.02.2017	23.02.2018	31 774 114	%	102.530	100.000	100.000		0.000	Y
6.99 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.02.2017	23.02.2018	31 774 127	%	106.380	100.000	100.000		0.000	Y
5.33 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.02.2017	23.02.2018	31 774 122	%	104.570	100.000	100.000		0.000	Y
3.56 % Reverse Convertible on Geberit N	CHF	1'000.00	08.02.2017	23.02.2018	31 774 125	%	102.810	100.000	100.000		0.000	Y
5.64 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	14.02.2017	23.02.2018	31 774 135	%	104.900	100.000	100.000		0.000	Y
4.97 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.02.2017	23.02.2018	31 774 137	%	104.190	100.000	100.000		0.000	Y
7.64 % Reverse Convertible on	GBP	1'000.00	17.02.2017	23.02.2018	31 774 150	%	106.510	100.000	100.000		0.000	Y
5.06 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.02.2017	23.02.2018	31 774 157	%	104.180	100.000	100.000		0.000	Y
3.32 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.06.2017	23.02.2018	36 437 867	%	101.320	100.000	100.000		0.000	Y
3.01 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.06.2017	23.02.2018	36 437 866	%	101.180	100.000	100.000		0.000	Y
Bonus-Cert. on Euro Stoxx 50-Index	EUR	100.00	24.04.2014	26.02.2018	24 293 677	CHF	127.310	97.232	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
3.66 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.02.2017	08.03.2018	31 774 175	%	102.820	100.000	100.000		0.000	Y
4.47 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.02.2017	08.03.2018	31 774 174	%	103.690	100.000	100.000		0.000	Y
4.24 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.03.2017	09.03.2018	31 774 182	%	103.340	100.000	100.000		0.000	Y
11.65 % Reverse Convertible on Equities 20.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	20.03.2017	20.03.2018	31 774 229		-	100.000	100.000		0.000	N
5.46 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	22.03.2017	22.03.2018	31 774 234	%	104.410	100.000	100.000		0.000	Y
7.16 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.02.2017	23.03.2018	31 774 171	%	106.660	100.000	100.000		0.000	Y
5.25 % Reverse Convertible on Equities 6.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	24.02.2017	23.03.2018	31 774 172		-	100.000	100.000		0.000	Y
5.25 % Reverse Convertible on Equities 6.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	24.02.2017	23.03.2018	31 774 170		-	100.000	100.000		0.000	Y
3.09 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.02.2017	23.03.2018	31 774 176	%	102.330	100.000	100.000		0.000	Y
6.88 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.03.2017	23.03.2018	31 774 191	%	106.400	100.000	100.000		0.000	Y
7.8 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.03.2017	23.03.2018	31 774 186	%	103.190	100.000	100.000		0.000	Y
3.64 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.03.2017	23.03.2018	31 774 202	%	102.900	100.000	100.000		0.000	Y
3.36 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	08.03.2017	23.03.2018	31 774 207	%	102.610	100.000	100.000		0.000	Y
5.61 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.03.2017	23.03.2018	31 774 210	%	104.860	100.000	100.000		0.000	Y
5.75 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.03.2017	23.03.2018	31 774 216	%	104.630	100.000	100.000		0.000	Y
3.62 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	22.03.2017	23.03.2018	31 774 235	%	102.650	100.000	100.000		0.000	Y
Bonus-Cert. on STOXX Europe 600 Oil & Gas	EUR	100.00	27.03.2015	29.03.2018	27 457 456	CHF	123.940	99.606	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	01.04.2016	03.04.2018	31 773 989	%	97.830	100.000	100.000		0.000	Y
1 % (4 % P.A.) Barrier Reverse Convertible on a Basket of Indices	CHF	1'000.00	17.04.2015	19.04.2018	26 684 734	%	99.880	100.000	100.000	19.01. 19.04. 17.07. 19.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
4.55 % Reverse Convertible on BAYER	GBP	1'000.00	24.03.2017	27.04.2018	31 774 242	%	102.940	100.000	100.000		0.000	Y
5.18 % Reverse Convertible on BASF	EUR	1'000.00	24.03.2017	27.04.2018	31 774 240	%	103.830	100.000	100.000		0.000	Y
3.12 % Reverse Convertible on Nestle N	CHF	1'000.00	27.03.2017	27.04.2018	31 774 247	%	102.270	100.000	100.000		0.000	Y
4.86 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	29.03.2017	27.04.2018	31 774 254	%	102.130	100.000	100.000		0.000	Y
3.66 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.04.2017	27.04.2018	31 774 272	%	102.970	100.000	100.000		0.000	Y
5.4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.04.2017	27.04.2018	31 774 278	%	104.750	100.000	100.000		0.000	Y
2.81 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.04.2017	27.04.2018	31 774 294	%	102.010	100.000	100.000		0.000	Y
4.92 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	25.04.2017	27.04.2018	31 774 299	%	103.610	100.000	100.000		0.000	Y
5.74 % Reverse Convertible on Adecco Group N	CHF	1'000.00	07.08.2017	27.04.2018	36 437 990	%	101.850	100.000	100.000		0.000	Y
2.29 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.10.2017	27.04.2018	38 025 942	%	99.170	100.000	100.000		0.000	Y
Partially Capital Protected Notes on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	07.05.2015	04.05.2018	26 684 793	%	93.060	96.879	100.000		0.000	Y
6.14 % Reverse Convertible on Air France-KLM	USD	1'000.00	10.05.2017	11.05.2018	36 437 930	%	104.110	100.000	100.000		0.000	Y
6.14 % Reverse Convertible on Air France - KLM	USD	1'000.00	10.05.2017	11.05.2018	36 437 931	%	104.110	100.000	100.000		0.000	Y
2.61 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.10.2017	25.05.2018	38 025 966	%	98.420	100.000	100.000		0.000	Y
6.48 % Reverse Convertible on Vivendi	EUR	1'000.00	24.11.2017	25.05.2018	38 671 824	%	100.500	100.000	100.000		0.000	Y
2.81 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.05.2017	28.05.2018	36 437 915	%	100.910	100.000	100.000		0.000	Y
5.22 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	08.05.2017	28.05.2018	36 437 925	%	102.460	100.000	100.000		0.000	Y
4.35 Revese Convertible on Equities	CHF	1'000.00	09.05.2017	28.05.2018	36 437 926	%	102.400	100.000	100.000		0.000	Y
9.19 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.05.2017	28.05.2018	36 437 952	%	106.440	100.000	100.000		0.000	Y
Worst-Of Barrier Reverse Convertible VRN on a Basket of Indices 6.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.403%	USD	1'000.00	03.06.2015	05.06.2018	26 684 869		-	96.479	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	09.06.2017	11.06.2018	36 437 858	%	102.440	100.000	100.000		0.000	Y
Bonus-Cert. on S&P Germany LargeMidCap Index	EUR	100.00	15.05.2014	15.06.2018	24 397 892	CHF	137.040	97.267	100.000		0.000	Y
2.1 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	15.06.2017	15.06.2018	36 437 870	%	100.000	100.000	100.000		0.000	Y
Bonus-Cert. on Shares-Basket	USD	1'000.00	17.12.2015	18.06.2018	28 204 285	CHF	2003.410	96.996	100.000		0.000	Y
2 % (4 % P.A.) Reverse Convertible Note on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	18.12.2015	18.06.2018	28 204 282	%	100.380	100.000	100.000	21.06. 21.12.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.06.2016	18.06.2018	31 774 180	CHF	958.540	98.112	100.000		0.000	Y
3.94 % Reverse Convertible on RWE I	CHF	1'000.00	16.06.2017	18.06.2018	36 437 872	%	93.660	100.000	100.000		0.000	Y
2 % (0.0540 % p.a.) Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	29.06.2017	06.07.2018	32 013 954	%	97.890	100.000	100.000	06.10.	0.000	N
4.94 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	06.07.2017	06.07.2018	36 437 902	%	99.970	100.000	100.000		0.000	Y
Best of / Worst of Bonus Certificate on a Basket of Indices	USD	1'000.00	10.07.2015	10.07.2018	28 204 059	CHF	1238.870	96.387	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
2.75 % Regd.Barrier Reverse Convertible Indices Called for red.on 12.07.17 at 100% 12.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	10.07.2014	12.07.2018	23 400 415		-	100.000	100.000	12.07.	1.900	N
Express Note VRN on a Basket of Indices 17.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	21.07.2015	16.07.2018	28 204 095		-	100.000	100.000		0.000	Y
Twin Win Autocallable Certificate on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	23.07.2015	23.07.2018	28 204 070	CHF	1074.740	99.414	100.000		0.000	Y
6.67 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.04.2017	27.07.2018	31 774 288	%	106.470	100.000	100.000		0.000	Y
7.51 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.04.2017	27.07.2018	31 774 287	%	98.550	100.000	100.000		0.000	Y
8.15 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.06.2017	27.07.2018	36 437 881	%	94.000	100.000	100.000		0.000	Y
7.55 % Reverse Convertible on Safran	EUR	1'000.00	04.07.2017	27.07.2018	36 437 899	%	102.170	100.000	100.000		0.000	Y
3.43 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.07.2017	27.07.2018	36 437 981	%	99.050	100.000	100.000		0.000	Y
6.96 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.11.2017	27.07.2018	38 671 825	%	99.200	100.000	100.000		0.000	Y
Autocallable Worst-Of Note on a Basket of Indices	USD	1'000.00	02.02.2016	03.08.2018	28 204 488	%	97.620	97.454	100.000		0.000	Y
Stepdown Note VRN on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	06.08.2015	06.08.2018	28 204 139	%	98.370	96.256	100.000		0.000	Y
5.79 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.07.2017	08.08.2018	36 437 963	%	100.960	100.000	100.000		0.000	Y
2.87 % Reverse Convertible on Roche Hldg DR	CHF	1'000.00	24.02.2017	24.08.2018	31 774 168	%	102.180	100.000	100.000		0.000	Y
8.48 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.08.2017	24.08.2018	36 438 004	%	105.160	100.000	100.000		0.000	Y
3.25 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.08.2017	24.08.2018	36 438 023	%	100.650	100.000	100.000		0.000	Y
Shark Note on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	04.09.2015	28.08.2018	28 204 172	%	105.580	96.714	100.000		0.000	Y
2.9 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.08.2017	30.08.2018	36 438 039	%	98.030	100.000	100.000		0.000	Y
Worst-Of Express Note VRN on a Baket of Shs	CHF	1'000.00	08.09.2015	11.09.2018	28 204 178	%	103.370	100.000	100.000		0.000	Y
4.85 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	28.08.2017	28.09.2018	36 438 031	%	97.610	100.000	100.000		0.000	Y
3.59 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	31.08.2017	28.09.2018	36 438 043	%	94.000	100.000	100.000		0.000	Y
3.75 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	31.08.2017	28.09.2018	36 438 042	%	94.190	100.000	100.000		0.000	Y
4.65 % Reverse Convertible on Sonova Hldg N	CHF	1'000.00	05.09.2017	28.09.2018	36 438 052	%	95.550	100.000	100.000		0.000	Y
7.06 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.09.2017	28.09.2018	36 438 073	%	102.700	100.000	100.000		0.000	Y
4.24 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.03.2017	26.10.2018	31 774 262	%	103.320	100.000	100.000		0.000	Y
Capital-Guaranteed-Cert on Euro Stoxx 50-Index	EUR	100.00	02.08.2013	31.10.2018	21 860 583	CHF	129.720	93.840	100.000		0.000	Y
3.71 % Worst-Of Barrier Reverse Convertible on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	03.11.2015	05.11.2018	28 204 407	%	108.610	100.000	100.000		0.000	Y
3.74 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	02.11.2016	23.11.2018	31 773 947	%	106.580	100.000	100.000		0.000	Y
3.83 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	03.11.2016	23.11.2018	31 773 950	%	106.760	100.000	100.000		0.000	Y
Best of / Worst of Bonus Certificate on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	29.05.2015	29.11.2018	26 684 835	CHF	701.300	100.000	100.000		0.000	Y
Capital-Guaranteed-Cert. 2021-28.12.18 on Euro Stoxx 50-Index	EUR	100.00	19.09.2013	28.12.2018	22 276 167	CHF	132.550	92.682	100.000		0.000	Y
5.47 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.06.2017	02.01.2019	36 437 891	%	93.840	100.000	100.000		0.000	Y
4.32 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	09.12.2016	03.01.2019	31 773 997	%	107.820	100.000	100.000		0.000	Y
4.86 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	19.12.2016	03.01.2019	31 774 004	%	108.140	100.000	100.000		0.000	Y
6.35 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.06.2017	03.01.2019	36 437 886	%	101.710	100.000	100.000		0.000	Y
Lookback Certificate on Euro Stoxx 50 Index	USD	100.00	23.07.2015	23.01.2019	28 204 104	CHF	104.320	95.459	100.000		0.000	Y
5.12 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	03.01.2017	25.01.2019	31 774 043	%	109.030	100.000	100.000		0.000	Y
4.93 % Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	03.01.2017	25.01.2019	31 774 042	%	108.240	100.000	100.000		0.000	Y
Coupon-Cert. on Societe Generale	EUR	100.00	13.02.2014	20.02.2019	23 584 262	CHF	120.520	95.083	100.000		0.000	Y
Participation-Cert. auf Euro Stoxx 50-Index	EUR	100.00	10.10.2013	11.03.2019	22 458 426	CHF	132.190	92.839	100.000		0.000	Y
5.2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	10'000.00	24.04.2017	30.04.2019	31 774 295	%	103.550	100.000	100.000		0.000	Y
Lookback Certificate on Euro Stoxx 50 Index	USD	100.00	08.05.2015	07.05.2019	26 684 800	CHF	104.300	94.666	100.000		0.000	Y
1.27 % Reverse Convertible on Novartis N	CHF	1'000.00	08.05.2017	24.05.2019	36 437 923	%	99.300	100.000	100.000		0.000	Y
1.14 % Reverse Convertible on Roche	CHF	1'000.00	08.05.2017	24.05.2019	36 437 922	%	96.780	100.000	100.000		0.000	Y
4.91 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	09.05.2017	24.05.2019	36 437 928	%	99.740	100.000	100.000		0.000	Y
Lookback Certificate on Euro Stoxx 50 Index	USD	100.00	26.05.2015	28.05.2019	26 684 849	CHF	108.290	94.047	100.000		0.000	Y
Dolphin Note on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	03.06.2014	03.06.2019	23 400 436	%	107.130	95.240	100.000		0.000	Y
2.9 % Reverse Convertible on Indices 1.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	27.05.2016	03.06.2019	31 773 832		-	100.000	100.000	03.03. 01.06.	7.230 7.150	N
4.18 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.05.2016	07.06.2019	31 773 848	%	109.050	100.000	100.000		0.000	Y
4.89 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.05.2017	07.06.2019	36 437 943	%	95.420	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Lookback Certificate on Euro Stoxx 50 Index	EUR	100.00	12.06.2015	12.06.2019	28 204 000	CHF	131.410	99.024	100.000		0.000	Y
1.25 % (pro rata)Reverse Convertible on Equities 11.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	10.06.2016	12.06.2019	31 773 858		-	100.000	100.000	13.03. 13.06. 11.09.	12.465 12.602 12.328	N
Dolphin Note on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	17.06.2014	17.06.2019	23 400 446	%	105.580	96.140	100.000		0.000	Y
Express-Cert. on GDF Suez	EUR	100.00	17.06.2014	26.06.2019	24 617 668	CHF	100.450	96.390	100.000		0.000	Y
Capital Protected Notes on Stx Hdlb 50 Eur P Index	USD	1'000.00	27.06.2014	27.06.2019	23 400 493	%	101.290	91.740	100.000		0.000	Y
Dolphin Note on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	30.06.2014	28.06.2019	23 400 496	%	105.790	96.670	100.000		0.000	Y
2.09 % Reverse Convertible on Givaudan N	CHF	5'000.00	13.06.2017	28.06.2019	36 437 864	%	101.350	100.000	100.000		0.000	Y
3.95 % Reverse Convertible on LafargeHolcim Ltd	CHF	1'000.00	13.06.2017	28.06.2019	36 437 863	%	98.810	100.000	100.000		0.000	Y
5.6 % Reverse Convertible on Equities Called for red.on 03.07.17 at 100% 3.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	01.07.2016	01.07.2019	31 774 195		-	100.000	100.000	04.01. 31.03. 03.07.	0.000 0.000 0.000	N
1.58 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.07.2017	26.07.2019	36 437 976	%	97.000	100.000	100.000		0.000	Y
Capital Protected Note on STX HDLB 50 EUR P Index	USD	1'000.00	29.07.2014	29.07.2019	23 400 455	%	102.890	91.600	100.000		0.000	Y
EUR Lookback Certificate on Euro Stoxx 50 Index	EUR	100.00	10.08.2015	12.08.2019	28 204 146	CHF	131.400	98.889	100.000		0.000	Y
4.79 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.08.2017	23.08.2019	36 437 983	%	99.760	100.000	100.000		0.000	Y
Capital-Guaranteed-Cert. on Euro Stoxx 50-Index	EUR	100.00	27.12.2013	27.09.2019	23 150 869	CHF	127.620	92.008	100.000		0.000	Y
Protection Participation on DeAWM Multi-product 2	USD	50'000.00	31.10.2014	08.11.2019	32 013 938	%	96.370	89.100	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	23.11.2016	25.11.2019	31 773 958	%	106.420	96.320	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	03.02.2017	05.02.2020	31 774 100	%	100.710	95.180	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	03.02.2017	05.02.2020	31 774 105	%	113.050	95.180	100.000		0.000	Y
PerfomancePlus-Cert. on GDF Suez	EUR	100.00	12.03.2015	25.03.2020	27 270 723	CHF	93.560	98.633	100.000		0.000	Y
Capital Protected Note on a Basket of Shs	USD	1'000.00	15.04.2015	15.04.2020	26 684 730	%	90.410	85.990	92.500		0.000	Y
Worst-Of Express Certificate on a Bskt of Indices	USD	100.00	30.04.2015	30.04.2020	26 684 808	CHF	118.010	93.000	100.000		0.000	Y
Worst-Of Autocall Note VRN on a Basket of Indices 7.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.531%	EUR	1'000.00	08.05.2015	08.05.2020	26 684 782		-	98.947	100.000		0.000	Y
Worst-Of Autocall Note VRN on a Basket of Indices 7.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.458%	USD	1'000.00	08.05.2015	08.05.2020	26 684 779		-	93.040	100.000		0.000	Y
Worst-Of Autocall Note VRN on a Basket of Indices 7.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.05.2015	08.05.2020	26 684 780		-	100.000	100.000		0.000	Y
Worst-Of Express Certificate on a Basket of Indices	USD	100.00	26.06.2015	26.06.2020	28 204 028	CHF	115.180	91.134	100.000		0.000	Y
Worst-Of Autocallable Note VRN on a Basket of Indices 8.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.282%	USD	1'000.00	08.09.2015	08.09.2020	28 204 180		-	92.702	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on Euro Stoxx 50 Price Index	USD	1'000.00	23.09.2015	23.09.2020	28 204 191	CHF	984.620	92.093	100.000		0.000	Y
Bonus Outperformance-Cert. on S&P 500-Index	USD	1'000.00	20.11.2015	20.11.2020	28 204 266	CHF	1268.190	92.001	100.000		0.000	Y
6.2 % CLN Credit Linked on Basket of Reference Entities	EUR	973.33	11.02.2016	20.12.2020	31 358 890	%	109.600	100.000	100.000	22.06. 22.12.	32.730 35.343	N
Structured Note on Thyssenkrupp AG	USD	250'000.00	14.07.2017	23.12.2020	32 013 960	%	98.560	100.000	100.000	22.09. 22.12.	1'265.59 1'763.11	N
(no min.) Autocallable Note FRN on a Basket of Indices 24.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.401%	USD	1'000.00	25.01.2016	25.01.2021	28 204 326		-	92.816	100.000		0.000	Y
Equity linked Note on a Basket of Shs	USD	1'000.00	27.01.2015	27.01.2021	26 096 761	%	99.100	91.170	100.000		0.000	Y
Capital Protected Note on STOXX Europe Low Beta High Ix	USD	1'000.00	22.03.2016	22.03.2021	28 204 339	%	103.510	84.554	90.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Protection Participation on Equities	CHF	1'000.00	15.04.2016	19.04.2021	31 774 050	%	101.850	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	22.04.2016	22.04.2021	31 215 907	%	120.480	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	27.04.2016	27.04.2021	31 773 880	%	111.180	94.289	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	09.05.2016	10.05.2021	31 774 044	%	111.840	93.650	100.000		0.000	Y
Structured Note on Euro Stoxx 50	USD	1'000.00	25.05.2016	25.05.2021	31 773 870	%	103.720	94.373	100.000		0.000	Y
Structured Note on S&P 500	USD	1'000.00	01.06.2016	01.06.2021	31 774 244	%	107.770	93.588	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	100'000.00	24.01.2017	08.02.2023	31 774 187	%	98.730	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 10.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	100'000.00	24.01.2017	08.02.2023	31 774 115		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 30.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	100'000.00	16.03.2017	30.03.2023	31 774 239		-	100.000	100.000	30.06.	0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 3.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	100'000.00	17.03.2017	31.03.2023	31 774 241		-	100.000	100.000	03.07.	534.51	N
Reverse Convertible on Indices 19.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	100'000.00	05.04.2017	24.04.2023	31 774 284		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 4.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	100'000.00	21.04.2017	05.05.2023	31 774 301		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 5.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	100'000.00	14.06.2017	06.07.2023	36 437 868		-	100.000	100.000	05.10.	459.60	N
Reverse Convertible on Indices 5.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	100'000.00	14.06.2017	06.07.2023	36 437 869		-	100.000	100.000	05.10.	0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	100'000.00	17.07.2017	17.07.2023	36 438 030	%	96.640	100.000	100.000	16.10.	492.45	N
Deutsche Bank Capital Finance Trust 1, Delaware, USA												
Notes 2005-without fixed maturity floating rate	EUR	1'000.00	27.06.2005		2 172 804	%	90.470	100.000	100.000	27.06.	19.058	N
DZ BANK AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank, Frankfurt A/ Main, Deutschland												
Bonus-Zert. auf Air Liquide	EUR	115.26	13.01.2016	24.03.2017	31 053 350		-	100.000	100.000		0.000	Y
DuoRendite Garant var.	EUR	200.00	06.06.2011	06.06.2017	13 323 491		-	84.249	100.000	06.06.	0.000	Y
4 % ZinsFix Control auf BMW	EUR	1'000.00	07.07.2014	07.07.2017	24 784 951		-	100.000	100.000	07.07.	4.284	N
VarioZins Garant var.	EUR	100.00	21.01.2011	21.07.2017	11 990 430		-	82.302	100.000		0.000	Y
DuoRendite Garant var.	EUR	200.00	10.09.2010	11.09.2017	11 565 392		-	86.341	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Volkswagen Vz	EUR	117.53	01.12.2016	22.12.2017	34 810 086		-	100.000	100.000		0.000	Y
2 % Kombi ZinsFix Express auf Euro Stoxx 50-Index 23.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	2'000.00	22.01.2016	22.01.2018	30 749 769		-		100.000	23.01.	43.165	N
Capped Bonus-Zert. auf Euro Stoxx 50-Index	EUR	100.00	24.04.2014	24.04.2018	23 959 882	CHF	139.010	96.908	100.000		0.000	Y
1.5 % ZinsFix Express auf Euro Stoxx 50-Index 22.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	100.00	22.05.2015	22.05.2018	27 851 230		-	100.000	100.000	22.05.	0.80937	N
Bonus Control Cap auf Euro Stoxx 50-Index	EUR	100.00	23.05.2014	23.05.2018	24 273 239	CHF	139.010	97.542	100.000		0.000	Y
Capped Bonus-Zert. 2014-23.5.18 auf Euro Stoxx 50-Index	EUR	100.00	23.05.2014	26.05.2018	24 532 522	CHF	139.010	97.542	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	29.59	15.07.2016	22.06.2018	33 283 079	CHF	40.460	100.000	100.000		0.000	Y
TwinWin Europa auf Euro Stoxx 50-Index	EUR	100.00	09.10.2014	09.10.2018	25 290 735	CHF	132.460	98.620	100.000		0.000	Y
Express plus auf N.-Akt.BASF 18.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.743%	EUR	1'000.00	18.07.2014	18.07.2019	24 909 591		-	96.917	100.000		0.000	Y
(ohne Min.) Memory Express auf Vz.-Akt. Volkswagen	EUR	1'000.00	06.02.2015	05.02.2021	26 535 607	CHF	1214.960	97.707	100.000		0.000	Y
Express auf N.-Akt. Daimler	EUR	1'000.00	21.08.2015	21.09.2021	29 144 107	CHF	1124.850	97.085	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
EFG International Finance (Guernsey) Limited, Guernsey												
Worst of Express Certificate 2012-04.01.17 on Equities	GBP	1'000.00	04.01.2013	04.01.2017	19 539 072		-	96.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.01.2015	09.01.2017	25 924 188		-	99.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on American Airlines	USD	1'000.00	09.01.2015	09.01.2017	25 823 073		-	98.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	03.07.2015	09.01.2017	28 371 044		-	98.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.07.2015	09.01.2017	28 371 062		-	98.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.07.2015	09.01.2017	28 370 951		-	98.930	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	11.04.2016	11.01.2017	31 185 428		-	100.000	100.000	11.01.	2.175	N
3.15 % Structured Note on Raiffeisen Bank	USD	1'000.00	09.10.2014	12.01.2017	25 445 052		-	100.000	100.000	12.01.	31.754	N
10 1/4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.01.2016	12.01.2017	29 347 905		-	100.000	100.000	12.01.	8.460	Y
9 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.01.2016	12.01.2017	29 347 902		-	100.000	100.000	12.01.	0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.01.2016	12.01.2017	29 347 904		-	100.000	100.000	12.01.	0.000	Y
9 1/4 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.01.2016	12.01.2017	29 347 903		-	100.000	100.000	12.01.	0.000	Y
Worst of Express Certificate 2012-13.01.17 on Equities	GBP	1'000.00	11.01.2013	13.01.2017	19 538 936		-	96.210	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.07.2015	16.01.2017	27 992 376		-	99.870	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	17.01.2014	17.01.2017	20 454 909		-	97.230	100.000		0.000	Y
8.43 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.01.2016	18.01.2017	29 347 927		-	100.000	100.000	18.01.	0.000	Y
4 1/2 % Reverse Convertible on Apple	USD	1'000.00	19.01.2016	19.01.2017	29 347 933		-	100.000	100.000	19.01.	7.980	Y
6.8 % Reverse Convertible on Alibaba Grp Sp ADS	USD	1'000.00	19.01.2016	19.01.2017	29 347 936		-	100.000	100.000	19.01.	8.080	Y
14.4 % Reverse Convertible on Twitter	USD	1'000.00	19.01.2016	19.01.2017	29 347 934		-	100.000	100.000	19.01.	7.980	Y
6 1/4 % Reverse Convertible on Facebook-A	USD	1'000.00	19.01.2016	19.01.2017	29 347 935		-	100.000	100.000	19.01.	8.080	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	20.07.2015	20.01.2017	28 370 881		-	98.640	100.000		0.000	Y
4 3/4 % Reverse Convertible on Intesa Sanpaolo	EUR	1'000.00	20.01.2016	20.01.2017	29 347 975		-	100.000	100.000	20.01.	0.000	Y
8.3 % Reverse Convertible on Hertz Global Hldgs	EUR	1'000.00	20.01.2016	20.01.2017	29 347 978		-	100.000	100.000	20.01.	0.000	Y
6.6 % Reverse Convertible on Sotheby's Hld-A-LV	EUR	1'000.00	20.01.2016	20.01.2017	29 347 977		-	100.000	100.000	20.01.	0.000	Y
4 1/2 % Reverse Convertible on Airbus Group	EUR	1'000.00	20.01.2016	20.01.2017	29 347 974		-	100.000	100.000	20.01.	0.000	Y
4 % Reverse Convertible on Lvmh	EUR	1'000.00	20.01.2016	20.01.2017	29 347 973		-	100.000	100.000	20.01.	0.000	Y
5.2 % Reverse Convertible on Alexion Pharm	EUR	1'000.00	20.01.2016	20.01.2017	29 347 976		-	100.000	100.000	20.01.	0.000	Y
4.65 % (9 % p.a.) Reverse Convertible on Barclays	GBP	1'000.00	14.07.2016	20.01.2017	32 339 365		-	100.000	100.000	20.01.	4.830	Y
Bonus Certificate on iShs FTSE China 25	USD	1'000.00	23.01.2013	23.01.2017	20 454 868		-	97.440	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Indices	USD	1'000.00	23.01.2014	23.01.2017	23 092 750		-	97.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.01.2015	23.01.2017	26 674 522		-	98.500	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.01.2015	23.01.2017	25 823 118		-	98.540	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	22.07.2015	23.01.2017	28 781 819		-	99.880	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on China Merchant - H-	HKD	500'000.00	18.01.2016	25.01.2017	29 347 896		-	99.140	100.000		0.000	Y
6.6 % Reverse Convertible on Air France - KLM	USD	1'000.00	25.01.2016	25.01.2017	29 347 986		-	100.000	100.000	25.01.	7.790	Y
6 % Reverse Convertible on Volkswagen Vz	USD	1'000.00	25.01.2016	25.01.2017	29 347 987		-	100.000	100.000	25.01.	7.790	Y
7.8 % Reverse Convertible on Sotheby's Hld-A-LV	USD	1'000.00	25.01.2016	25.01.2017	29 347 988		-	100.000	100.000	25.01.	7.790	Y
11 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.01.2016	26.01.2017	30 497 907		-	100.000	100.000	26.01.	0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	30.01.2014	30.01.2017	23 092 696		-	96.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	30.01.2014	30.01.2017	23 092 697		-	97.290	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	30.07.2014	30.01.2017	24 565 009		-	99.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.01.2015	30.01.2017	25 823 155		-	98.540	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ICBC-H	USD	500'000.00	21.01.2016	30.01.2017	29 347 920		-	99.180	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	31.01.2014	31.01.2017	22 226 756		-	97.580	100.000		0.000	Y
Capital Protection-Cert.	GBP	1.00	31.01.2014	31.01.2017	23 092 810		-	86.170	90.000		0.000	Y
Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	01.08.2014	01.02.2017	24 565 181		-	98.634	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Alibaba Grp Sp ADS	USD	1'000.00	02.02.2015	02.02.2017	25 823 170		-	98.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.08.2015	03.02.2017	28 781 902		-	99.020	100.000		0.000	Y
3.87 % (7 1/4 % p.a.) Reverse Convertible on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	21.07.2016	03.02.2017	32 339 569		-	100.000	100.000	03.02.	0.000	Y
8.09 % (15 1/2 % p.a.) Reverse Convertible on ArcelorMittal Reg	EUR	1'000.00	25.07.2016	03.02.2017	32 339 568		-	100.000	100.000	03.02.	0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4.15 % (8.03 % p.a.) Reverse Convertible on Barclays	GBP	1'000.00	27.07.2016	03.02.2017	32 339 559		-	100.000	100.000	03.02.	3.950	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	06.02.2013	06.02.2017	20 455 003		-	95.910	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	11.02.2013	06.02.2017	19 539 133		-	96.190	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	13.02.2014	06.02.2017	23 093 114		-	97.540	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.02.2015	06.02.2017	25 823 186		-	98.520	100.000	06.02.		Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.08.2015	06.02.2017	27 992 475		-	99.880	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	07.02.2014	07.02.2017	22 850 896		-	96.030	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	07.02.2014	07.02.2017	23 093 119		-	97.580	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible on BHP Billiton	GBP	1'000.00	08.02.2016	08.02.2017	30 040 813		-	100.000	100.000	08.02.	7.590	Y
4 % Reverse Convertible on iSh Co FTSE 100 GBP	GBP	1'000.00	08.02.2016	08.02.2017	30 040 814		-	100.000	100.000	08.02.	7.590	Y
8.4 % (8.42 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	09.02.2016	08.02.2017	30 040 838		-	100.000	100.000	08.02.	0.000	Y
Protection Participation on XAU/EUR FIXING	EUR	1'000.00	09.02.2016	10.02.2017	31 185 295		-	95.000	95.000		0.000	Y
Capital Protection Certificate on Euro Stoxx 50-Index	EUR	1'000.00	12.02.2013	13.02.2017	20 455 115		-	96.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Barc iPath ETN 19-A	USD	1'000.00	11.02.2016	13.02.2017	31 185 275		-	99.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.08.2015	14.02.2017	28 371 021		-	99.900	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on CS Group N	CHF	1'000.00	15.02.2016	15.02.2017	30 040 860		-	100.000	100.000	15.02.	0.000	Y
3.89 % (7 % p.a.) Reverse Convertible on Apple	USD	1'000.00	25.07.2016	15.02.2017	32 829 433		-	100.000	100.000	15.02.	7.190	Y
4.72 % (8 1/2 % p.a.) Reverse Convertible on Gilead Sciences	USD	1'000.00	25.07.2016	15.02.2017	32 829 434		-	100.000	100.000	15.02.	7.190	Y
4.17 % (7 1/2 % p.a.) Reverse Convertible on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	25.07.2016	15.02.2017	32 829 432		-	100.000	100.000	15.02.	0.000	Y
4.44 % (8 % p.a.) Reverse Convertible on Alibaba Grp Sp ADS	USD	1'000.00	25.07.2016	15.02.2017	32 829 435		-	100.000	100.000	15.02.	7.190	Y
4.44 % (8 % p.a.) Reverse Convertible on BMW	EUR	1'000.00	25.07.2016	15.02.2017	32 829 430		-	100.000	100.000	15.02.	0.000	Y
3.89 % (7 % p.a.) Reverse Convertible on BASF N	EUR	1'000.00	25.07.2016	15.02.2017	32 829 431		-	100.000	100.000	15.02.	0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	21.02.2014	21.02.2017	23 580 955		-	97.640	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	21.02.2014	21.02.2017	23 580 918		-	97.700	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.02.2015	23.02.2017	25 924 329		-	98.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.02.2016	24.02.2017	30 040 825		-	99.300	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	27.02.2013	27.02.2017	11 218 053		-	97.020	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	01.03.2013	27.02.2017	20 571 532		-	97.060	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	27.08.2014	27.02.2017	24 565 386		-	96.680	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.02.2015	27.02.2017	26 674 774		-	98.260	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Apple	USD	1'000.00	22.02.2016	01.03.2017	30 040 884		-	99.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Sotheby's Hld-A-LV	CHF	1'000.00	29.02.2016	01.03.2017	31 524 380		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Credit Agricole	EUR	1'000.00	29.02.2016	01.03.2017	31 524 381		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Harley-Davidson	EUR	1'000.00	29.02.2016	01.03.2017	31 524 383		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Deutsche Bank N	USD	1'000.00	01.03.2016	02.03.2017	31 524 384		-	99.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Sotheby's Hld-A-LV	USD	1'000.00	01.03.2016	02.03.2017	31 524 385		-	99.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Deutsche Bank N	USD	1'000.00	01.03.2016	02.03.2017	31 524 387		-	99.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Twitter	USD	1'000.00	01.03.2016	02.03.2017	31 524 386		-	99.440	100.000		0.000	Y
Various Participation on JPMCCI Aggregate Excess	CHF	1'000.00	03.03.2010	03.03.2017	11 062 248		-	87.480	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	03.09.2014	03.03.2017	24 565 513		-	96.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.03.2015	03.03.2017	26 673 886		-	98.340	100.000		0.000	Y
Express-Cert. on Basket	EUR	50'000.00	04.03.2011	06.03.2017	12 461 103		-	83.780	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	06.03.2013	06.03.2017	11 218 057		-	96.750	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	06.03.2014	06.03.2017	23 092 889		-	97.580	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	04.03.2015	06.03.2017	27 214 210		-	98.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CAD	1'000.00	08.09.2015	08.03.2017	27 992 638		-	98.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on China Life Ins -H-	HKD	10'000.00	09.03.2015	09.03.2017	27 214 216		-	98.220	100.000		0.000	Y
6.7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	09.03.2016	09.03.2017	30 041 010		-	100.000	100.000	09.03.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.02.2015	10.03.2017	26 674 783		-	98.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.03.2015	10.03.2017	27 214 277		-	98.200	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	10.03.2015	10.03.2017	27 214 286		-	99.800	100.000		0.000	Y
Capital Protection Certificate on ESTX50 EURP	EUR	1'000.00	12.03.2013	13.03.2017	20 571 679		-	97.090	100.000		0.000	Y
Capital Protection Certificate on ESTX50 EURP	USD	1'000.00	12.03.2013	13.03.2017	20 571 678		-	97.250	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.03.2015	13.03.2017	26 674 844		-	98.200	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	19.03.2014	14.03.2017	23 580 986		-	96.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.03.2015	16.03.2017	27 339 291		-	99.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	16.09.2015	16.03.2017	27 992 687		-	98.960	100.000		0.000	Y
Capital Protection Note on basket	GBP	1'000.00	17.07.2012	17.03.2017	18 961 510		-	79.690	100.000		0.000	Y
Express Certificate Gearing on Equities	EUR	1'000.00	19.03.2014	17.03.2017	23 581 092		-	98.220	100.000		0.000	Y
Outperformance Certificate on STXESm200 EUR P	EUR	1'000.00	18.03.2014	20.03.2017	23 581 154		-	98.130	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Indices	USD	1'000.00	20.03.2014	20.03.2017	23 581 166		-	97.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.03.2015	20.03.2017	27 214 230		-	99.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	AUD	1'000.00	20.03.2015	20.03.2017	26 674 738		-	95.680	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.03.2015	20.03.2017	27 339 269		-	99.840	100.000		0.000	Y
13.07 % (13 % p.a.) Reverse Convertible on Basket	TRY	1'000.00	18.03.2016	20.03.2017	31 524 525		-	100.000	100.000	20.03.	28.490	N
10 1/2 % Reverse Convertible on Basket	ZAR	1'000.00	18.03.2016	20.03.2017	31 524 526		-	100.000	100.000	20.03.	5.886	N
6.2 % Reverse Convertible on Basket	MXN	1'000.00	18.03.2016	20.03.2017	31 524 527		-	100.000	100.000	20.03.	2.133	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.09.2014	22.03.2017	24 205 175		-	97.540	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CSOP FTSE HKD ETF	HKD	2'000'000.00	15.03.2016	22.03.2017	30 040 986		-	98.720	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CSOP FTSE HKD ETF	HKD	100'000.00	15.03.2016	22.03.2017	30 040 988		-	98.720	100.000		0.000	Y
10 1/2 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.03.2016	22.03.2017	30 041 115		-	100.000	100.000	22.03.	8.110	Y
Reverse Convertible on S&P GSCI Crd OilER	USD	1'000.00	23.03.2015	23.03.2017	27 339 275		-	98.170	100.000		0.000	Y
31.1 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.03.2016	23.03.2017	30 041 123		-	100.000	100.000	23.03.	8.330	Y
2.14 % (4 1/4 % p.a.) Reverse Convertible on USD 10Y Swap	USD	1'000.00	22.09.2016	23.03.2017	33 851 325		-	100.000	100.000	23.03.	5.930	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.09.2014	24.03.2017	24 205 177		-	99.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on LinkedIn-A	USD	1'000.00	24.03.2015	24.03.2017	26 673 975		-	98.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Sears Holdings	USD	1'000.00	24.03.2015	24.03.2017	26 673 976		-	98.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Unicredit	USD	1'000.00	24.03.2015	24.03.2017	26 673 972		-	98.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.03.2015	24.03.2017	26 673 979		-	98.190	100.000		0.000	Y
32 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.03.2016	24.03.2017	30 041 134		-	100.000	100.000	24.03.	7.530	Y
25.68 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.03.2016	24.03.2017	30 041 135		-	100.000	100.000	24.03.	7.630	Y
27.15 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.03.2016	24.03.2017	30 041 138		-	100.000	100.000	24.03.	7.630	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	27.03.2015	27.03.2017	26 674 006		-	99.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Repsol	EUR	1'000.00	27.03.2015	27.03.2017	26 674 007		-	99.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Ford Motor	USD	1'000.00	27.03.2015	27.03.2017	26 673 999		-	98.360	100.000		0.000	Y
17 3/4 % Reverse Convertible on Twitter	USD	1'000.00	28.03.2016	28.03.2017	31 185 346		-	100.000	100.000	28.03.	7.570	Y
19 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.03.2016	28.03.2017	31 185 342		-	100.000	100.000	28.03.	7.570	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.09.2014	29.03.2017	24 205 221		-	97.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.09.2014	29.03.2017	24 205 247		-	97.490	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	GBP	50'000.00	22.03.2016	29.03.2017	30 041 074		-	99.390	100.000		0.000	Y
5.41 % (5 1/2 % p.a.) Reverse Convertible on Intel	USD	1'000.00	05.04.2016	29.03.2017	31 185 401		-	100.000	100.000	29.03.	12.020	Y
5.9 % (6 % p.a.) Reverse Convertible on Apple	USD	1'000.00	05.04.2016	29.03.2017	31 185 399		-	100.000	100.000	29.03.	12.020	Y
6.88 % (7 % p.a.) Reverse Convertible on Gilead Sciences	USD	1'000.00	05.04.2016	29.03.2017	31 185 400		-	100.000	100.000	29.03.	12.020	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	30.09.2014	30.03.2017	25 444 930		-	96.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.03.2015	30.03.2017	27 339 361		-	99.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Vodafone Group	GBP	1.84	02.03.2016	30.03.2017	31 524 395		-	99.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	31.03.2015	31.03.2017	26 674 012		-	99.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.04.2015	31.03.2017	26 673 990		-	98.150	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	50'000.00	24.03.2016	31.03.2017	30 041 099		-	99.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Nokia Sp ADR	USD	1'000.00	03.04.2015	03.04.2017	26 674 035		-	98.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.04.2015	03.04.2017	26 674 032		-	98.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on American Express	USD	1'000.00	03.04.2015	03.04.2017	26 674 034		-	98.400	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	04.04.2014	04.04.2017	23 581 231		-	97.000	100.000		0.000	Y
4.6 % Reverse Convertible on Total	USD	1'000.00	05.04.2016	05.04.2017	31 185 391		-	100.000	100.000	05.04.	8.030	Y
5 % Reverse Convertible on Citigroup	USD	1'000.00	05.04.2016	05.04.2017	31 185 393		-	100.000	100.000	05.04.	8.030	Y
6 % Reverse Convertible on Peugeot	USD	1'000.00	05.04.2016	05.04.2017	31 185 390		-	100.000	100.000	05.04.	8.030	Y
6.9 % Reverse Convertible on Renault	USD	1'000.00	05.04.2016	05.04.2017	31 185 389		-	100.000	100.000	05.04.	8.030	Y
6.7 % Reverse Convertible on Expedia	USD	1'000.00	05.04.2016	05.04.2017	31 185 394		-	100.000	100.000	05.04.	8.030	Y
11 1/2 % Reverse Convertible on Tesla Motors	USD	1'000.00	05.04.2016	05.04.2017	31 185 392		-	100.000	100.000	05.04.	8.030	Y
Reverse Convertible on Equities 6.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.91%	USD	1'000.00	06.10.2014	06.04.2017	24 205 303		-	97.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	30.03.2015	06.04.2017	27 339 306		-	98.050	100.000		0.000	Y
10.1 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.04.2016	06.04.2017	31 185 419		-	100.000	100.000	06.04.	7.530	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
10.66 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.04.2016	06.04.2017	31 185 418		-	100.000	100.000	06.04.	7.530	Y
9.92 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.04.2016	06.04.2017	31 185 415		-	100.000	100.000	06.04.	7.530	Y
8.92 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.04.2016	06.04.2017	31 185 416		-	100.000	100.000	06.04.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Ishs Cr S&P Sm Cap	USD	100.00	06.04.2016	06.04.2017	31 185 409		-	100.000	100.000	06.04.	0.760	Y
12.48 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.04.2016	06.04.2017	31 185 417		-	100.000	100.000	06.04.	7.530	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	03.04.2015	07.04.2017	26 674 037		-	99.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.04.2015	07.04.2017	27 339 521		-	98.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	07.10.2015	07.04.2017	29 348 187		-	99.940	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on China Life Ins -H-	HKD	100'000.00	31.03.2016	07.04.2017	30 041 131		-	98.720	100.000		0.000	Y
5.6 % Reverse Convertible on Air France - KLM	USD	1'000.00	07.04.2016	07.04.2017	31 185 425		-	100.000	100.000	07.04.	7.450	Y
6.1 % Reverse Convertible on HP	USD	1'000.00	07.04.2016	07.04.2017	31 185 424		-	100.000	100.000	07.04.	7.450	Y
Capital Protection with a Reference Bond on Euro Stoxx 50-Index	EUR	1'000.00	25.05.2012	10.04.2017	18 565 846		-	85.706	100.000	10.04.	24.040	Y
Reverse Convertible on Bc Santander Sp ADR	USD	1'000.00	09.04.2015	10.04.2017	26 674 001		-	98.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	10.04.2015	10.04.2017	26 674 062		-	99.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on S&P GSCI Crd OilER	USD	1'000.00	10.04.2015	10.04.2017	26 674 077		-	98.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Ariad Pharmaceutic	USD	1'000.00	12.11.2015	11.04.2017	29 348 184		-	98.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Mket Vect Gld Min	USD	1'000.00	12.11.2015	11.04.2017	29 348 185		-	98.950	100.000		0.000	Y
7.2 % Reverse Convertible on Air France - KLM	EUR	1'000.00	12.04.2016	12.04.2017	31 185 447		-	100.000	100.000	12.04.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.10.2014	13.04.2017	25 445 073		-	99.480	100.000		0.000	Y
9.05 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.04.2016	13.04.2017	31 185 452		-	100.000	100.000	13.04.	7.430	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.04.2015	14.04.2017	26 674 087		-	98.480	100.000		0.000	Y
8 3/4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.04.2016	14.04.2017	31 185 463		-	100.000	100.000	14.04.	7.310	Y
Reverse Convertible on E.ON N	EUR	1'000.00	17.04.2015	17.04.2017	26 674 113		-	99.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.04.2015	17.04.2017	26 674 061		-	99.840	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	02.05.2013	18.04.2017	20 571 800		-	97.390	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.69%	USD	1'000.00	11.04.2016	18.04.2017	31 185 440		-	99.240	100.000		0.000	Y
Multi Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	20.04.2012	20.04.2017	18 260 167		-	95.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	20.10.2014	20.04.2017	24 205 378		-	99.430	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	21.04.2014	21.04.2017	23 581 246		-	97.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.04.2015	21.04.2017	27 339 573		-	99.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Repsol	EUR	1'000.00	21.04.2015	21.04.2017	26 674 135		-	99.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.10.2014	24.04.2017	25 445 190		-	99.430	100.000	24.02. 24.03. 24.04.	0.000 0.000 0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 15.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.807%	USD	1'000.00	23.04.2015	24.04.2017	26 674 110		-	98.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ConocoPhillips	USD	1'000.00	24.04.2015	24.04.2017	26 674 184		-	98.500	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.04.2015	24.04.2017	26 674 153		-	99.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Orange	EUR	1'000.00	24.04.2015	24.04.2017	26 674 186		-	99.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Hewlett-Packard	USD	1'000.00	24.04.2015	24.04.2017	26 674 183		-	98.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ConocoPhillips	USD	1'000.00	24.04.2015	24.04.2017	26 674 189		-	98.500	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Xerox Corp	USD	1'000.00	24.04.2015	24.04.2017	26 674 182		-	98.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.09.2015	24.04.2017	28 781 952		-	98.790	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CSOP FTSE HKD ETF	HKD	11'260.00	13.04.2016	24.04.2017	31 185 407		-	98.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.04.2015	25.04.2017	27 339 616		-	99.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	10'000.00	14.04.2016	25.04.2017	31 185 427		-	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Abercrombie Ftch-A	EUR	1'000.00	25.04.2016	25.04.2017	31 185 521		-	100.000	100.000	25.04.	0.000	Y
Protection Participation on S&P 500	USD	1'000.00	26.07.2016	26.04.2017	33 244 681		-	89.110	90.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CSOP FTSE HKD ETF	HKD	2'010'720.00	20.04.2016	27.04.2017	31 185 449		-	98.710	100.000		0.000	Y
2.92 % (5 % p.a.) Reverse Convertible on Commodities	EUR	1'000.00	27.09.2016	27.04.2017	33 597 662		-	100.000	100.000	27.04.	0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	28.10.2013	28.04.2017	21 989 291		-	96.710	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	28.10.2013	28.04.2017	21 989 290		-	96.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on US Steel 26.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.743%	USD	1'000.00	28.04.2015	28.04.2017	26 674 226		-	98.440	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 26.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	18.04.2016	28.04.2017	31 185 485		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Freeport McMoRan	USD	1'000.00	01.05.2015	01.05.2017	26 674 240		-	98.420	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Indices	CAD	1'000.00	02.05.2014	02.05.2017	23 092 992		-	95.320	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	02.05.2014	02.05.2017	23 581 214		-	95.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CSOP FTSE HKD ETF	HKD	500'000.00	22.04.2016	02.05.2017	31 185 476		-	98.700	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Funds	USD	1'851'000.00	22.04.2016	02.05.2017	31 185 467		-	99.260	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on TOYOTA MOTOR	JPY	1'000'000.00	26.04.2016	02.05.2017	31 185 487		-	100.000	100.000		0.000	Y
Express-Cert. on Equities	GBP	1'000.00	04.05.2012	04.05.2017	18 082 802		-	92.010	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	04.05.2012	04.05.2017	18 259 974		-	94.580	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.05.2015	04.05.2017	27 991 956		-	99.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	05.05.2015	05.05.2017	27 339 634		-	98.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	05.05.2015	05.05.2017	26 674 219		-	99.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	06.05.2015	05.05.2017	27 991 975		-	99.880	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	08.11.2013	08.05.2017	22 406 601		-	97.050	100.000		0.000	Y
Capital Protection-Cert.	GBP	1'000.00	15.05.2014	08.05.2017	24 205 662		-	97.240	100.000	08.05.	7.710	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.05.2015	08.05.2017	27 339 742		-	99.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.05.2015	08.05.2017	26 674 276		-	98.420	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	08.05.2015	08.05.2017	26 674 282		-	99.840	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	08.05.2015	08.05.2017	26 674 281		-	98.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	GBP	1'000.00	08.05.2015	08.05.2017	26 674 283		-	98.070	100.000		0.000	Y
9 1/2 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.05.2016	09.05.2017	31 185 576		-	100.000	100.000	09.05.	7.740	Y
11 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.05.2016	09.05.2017	31 185 574		-	100.000	100.000	09.05.	7.840	Y
Capped Bonus-Cert. on Basket	EUR	1'000.00	10.05.2012	10.05.2017	18 260 026		-	93.610	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	16.05.2013	10.05.2017	21 057 723		-	97.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.02.2016	10.05.2017	30 040 853		-	99.160	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.02.2016	10.05.2017	30 040 854		-	99.160	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CSOP FTSE HKD ETF	HKD	500'000.00	04.05.2016	11.05.2017	31 185 535		-	98.720	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on HSBC Hldg	HKD	100'000.00	04.05.2016	11.05.2017	31 185 534		-	98.720	100.000		0.000	Y
9.55 % (19.00 % p.a.) Reverse Convertible on Crude Oil	USD	1'000.00	10.11.2016	11.05.2017	34 443 826		-	100.000	100.000	11.05.	6.270	Y
Worst of Express Certificate on Funds	GBP	1'000.00	19.05.2014	12.05.2017	24 205 612		-	95.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.05.2015	12.05.2017	26 674 329		-	98.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.05.2015	12.05.2017	26 674 332		-	98.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.05.2015	12.05.2017	27 992 002		-	98.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.05.2015	12.05.2017	26 674 330		-	98.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.05.2015	12.05.2017	27 992 041		-	98.250	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	15.05.2014	15.05.2017	24 205 646		-	97.120	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	29.05.2014	15.05.2017	24 205 616		-	97.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.05.2015	15.05.2017	27 992 040		-	99.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Coca-Cola Co	USD	1'000.00	15.05.2015	15.05.2017	26 674 337		-	98.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Chart Industries 13.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.716%	USD	1'000.00	15.05.2015	15.05.2017	26 674 353		-	98.260	100.000		0.000	Y
5.63 % (7 1/2 % p.a.) Reverse Convertible on Airbus Group	USD	1'000.00	16.08.2016	16.05.2017	33 244 839		-	100.000	100.000	16.05.	10.060	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.05.2015	17.05.2017	27 339 654		-	98.330	100.000		0.000	Y
9.48 % Reverse Convertible on USD 10Y Swap	USD	10'000.00	11.08.2016	18.05.2017	33 244 941		-	100.000	100.000	18.01. 18.02. 18.03. 18.04. 18.05.	9.424 9.430 9.378 9.397 9.207	N
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	24.05.2013	19.05.2017	21 229 542		-	97.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.05.2015	19.05.2017	26 674 305		-	99.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on CS Group N	CHF	12.80	19.02.2016	19.05.2017	31 524 336		-	99.970	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Crude Oil	USD	1'000.00	19.05.2016	19.05.2017	31 185 633		-	89.330	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.05.2015	22.05.2017	26 674 452		-	98.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on HSBC Hldg	HKD	1'300'000.00	17.05.2016	24.05.2017	31 185 581		-	98.710	100.000		0.000	Y
3.45 % (6 % p.a.) Reverse Convertible on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	27.10.2016	24.05.2017	34 080 473		-	100.000	100.000	24.05.	0.000	Y
4.31 % (7 1/2 % p.a.) Reverse Convertible on Telefonica	EUR	1'000.00	27.10.2016	24.05.2017	34 080 472		-	100.000	100.000	24.05.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	25.11.2015	25.05.2017	30 040 786		-	98.770	100.000		0.000	Y
6.69 % (10.8 % p.a.) Reverse Convertible on Deutsche Bank N	USD	1'000.00	13.10.2016	26.05.2017	33 851 247		-	100.000	100.000	26.05.	7.150	Y
6.60 % (12.50 % p.a.) Reverse Convertible on Barrick Gold	EUR	1'000.00	16.11.2016	26.05.2017	34 443 644		-	100.000	100.000	26.05.	0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
3.41 % (6.50 % p.a.) Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	1'000.00	17.11.2016	26.05.2017	34 443 646		-	100.000	100.000	26.05.	0.000	Y
3.41 % (6.50 % p.a.) Reverse Convertible on Zurich Insur Grp N	CHF	1'000.00	17.11.2016	26.05.2017	34 443 645		-	100.000	100.000	26.05.	0.000	Y
4.99 % (9.50 % p.a.) Reverse Convertible on Telefonica	EUR	1'000.00	17.11.2016	26.05.2017	34 443 649		-	100.000	100.000	26.05.	0.000	Y
2.89 % (5.50 % p.a.) Reverse Convertible on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	17.11.2016	26.05.2017	34 443 648		-	100.000	100.000	26.05.	0.000	Y
2.89 % (5.50 % p.a.) Reverse Convertible on Richemont N	CHF	1'000.00	17.11.2016	26.05.2017	34 443 647		-	100.000	100.000	26.05.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.05.2015	29.05.2017	26 674 490		-	98.360	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.05.2015	29.05.2017	27 339 678		-	98.380	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	30.05.2014	30.05.2017	24 205 656		-	98.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.716%	USD	1'000.00	01.06.2015	01.06.2017	26 674 499		-	98.280	100.000		0.000	Y
Bonus Certificate on iSh MSCI ACWI	USD	1'000.00	02.06.2014	02.06.2017	24 205 774		-	97.410	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.713%	USD	100.00	02.06.2015	02.06.2017	27 339 708		-	98.260	100.000		0.000	Y
9 % Reverse Convertible on Crude Oil 2.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	02.09.2016	02.06.2017	33 597 707		-	100.000	100.000	02.03. 02.06.	0.000 0.000	N
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	05.12.2013	05.06.2017	22 406 733		-	97.490	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	05.06.2014	05.06.2017	23 581 349		-	98.660	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	05.06.2014	05.06.2017	24 205 583		-	97.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	05.12.2014	05.06.2017	25 923 966		-	97.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.05.2015	05.06.2017	27 991 943		-	98.390	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	200'000.00	05.06.2015	05.06.2017	27 992 091		-	98.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.06.2015	05.06.2017	27 992 070		-	98.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	05.06.2015	05.06.2017	27 992 780		-	98.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.06.2015	05.06.2017	27 992 068		-	98.280	100.000		0.000	Y
Protection Participation on USD/CHF	CHF	1'000.00	06.06.2016	06.06.2017	32 339 480		-	90.000	90.000		0.000	Y
Protection Participation on GBP/USD	GBP	1'000.00	06.06.2016	06.06.2017	32 339 481		-	89.330	90.000		0.000	Y
Protection Participation on EUR/USD	EUR	1'000.00	06.06.2016	06.06.2017	32 339 479		-	90.000	90.000		0.000	Y
Magnet-Cert. on Basket	CHF	1'000.00	05.06.2012	07.06.2017	18 425 921		-	95.250	100.000	07.06.	7.500	Y
Protection Participation on XAU/USD Fixing	EUR	1'000.00	07.06.2016	07.06.2017	32 339 483		-	90.000	90.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Vertex Pharmaceutic	EUR	1'000.00	07.06.2016	07.06.2017	31 185 707		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on China Constrct Bk-H	HKD	2'000'000.00	01.06.2016	08.06.2017	31 185 656		-	99.080	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	09.06.2015	09.06.2017	27 992 803		-	99.780	100.000		0.000	Y
7 1/4 % Reverse Convertible on Schlumberger	CHF	1'000.00	09.06.2016	09.06.2017	30 041 219		-	100.000	100.000	09.06.	0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	12.06.2014	12.06.2017	24 205 858		-	97.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.06.2015	12.06.2017	27 992 844		-	98.360	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.06.2015	12.06.2017	27 992 781		-	99.740	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.06.2015	12.06.2017	28 370 809		-	98.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	50'000.00	12.06.2015	12.06.2017	27 992 126		-	98.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.06.2015	12.06.2017	27 992 154		-	98.240	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	13.06.2014	13.06.2017	24 205 859		-	97.200	100.000		0.000	Y
6 3/4 % Reverse Convertible on Air France - KLM	EUR	1'000.00	13.06.2016	13.06.2017	31 185 748		-	100.000	100.000	13.06.	0.000	Y
6 3/4 % Reverse Convertible on Vivendi	EUR	1'000.00	13.06.2016	13.06.2017	31 185 749		-	100.000	100.000	13.06.	0.000	Y
5.03 % (6.7 % p.a.) Reverse Convertible on LafargeHolcim N	GBP	1'000.00	13.09.2016	13.06.2017	33 597 503		-	100.000	100.000	13.06.	5.830	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.03.2016	14.06.2017	31 524 404		-	99.080	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.03.2016	14.06.2017	31 524 414		-	99.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.03.2016	14.06.2017	31 524 405		-	99.080	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	1'264'174.00	07.06.2016	14.06.2017	31 185 689		-	98.740	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	979'961.00	07.06.2016	14.06.2017	31 185 690		-	98.740	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	01.06.2015	15.06.2017	26 674 466		-	98.270	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	15.03.2016	15.06.2017	30 041 080		-	99.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.06.2015	16.06.2017	27 992 119		-	98.240	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Funds	USD	1'000.00	18.06.2013	19.06.2017	21 385 635		-	95.870	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	17.06.2014	19.06.2017	24 205 850		-	98.630	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	19.06.2014	19.06.2017	24 564 764		-	95.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.06.2015	19.06.2017	27 992 097		-	99.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.06.2015	19.06.2017	27 992 901		-	98.030	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	20.06.2014	20.06.2017	24 205 584		-	96.890	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	20.06.2014	20.06.2017	24 202 956		-	98.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.06.2015	20.06.2017	27 992 824		-	98.380	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	20.06.2015	20.06.2017	24 202 953		-	98.810	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.06.2016	20.06.2017	32 339 493		-	99.170	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	50'000.00	13.09.2016	20.06.2017	32 829 389		-	92.500	93.500		0.000	Y
Protection Participation on XAU/USD Fixing	USD	1'000.00	22.06.2016	21.06.2017	32 339 622		-	88.883	90.000		0.000	Y
Protection Participation on XAU/USD Fixing	CHF	1'000.00	24.06.2016	21.06.2017	32 339 623		-	90.000	90.000		0.000	Y
Protection Participation on XAU/USD Fixing	EUR	1'000.00	24.06.2016	21.06.2017	32 339 621		-	90.000	90.000		0.000	Y
Protection Participation on EUR/USD	USD	1'000.00	24.06.2016	21.06.2017	32 829 397		-	88.892	90.000		0.000	Y
7.05 % (12.5 % p.a.) Reverse Convertible on Barrick Gold	EUR	1'000.00	28.11.2016	21.06.2017	34 443 959		-	100.000	100.000	21.06.	0.000	Y
3.67 % (6.5 % p.a.) Reverse Convertible on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	28.11.2016	21.06.2017	34 443 961		-	100.000	100.000	21.06.	0.000	Y
3.67 % (6.5 % p.a.) Reverse Convertible on Zurich Insur Grp N	CHF	1'000.00	28.11.2016	21.06.2017	34 443 960		-	100.000	100.000	21.06.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.06.2015	22.06.2017	27 992 112		-	98.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.06.2015	22.06.2017	27 992 907		-	98.080	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	22.06.2015	22.06.2017	28 370 857		-	97.950	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	23.12.2013	23.06.2017	22 406 787		-	97.280	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	23.06.2014	23.06.2017	24 204 884		-	98.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	02.06.2015	23.06.2017	27 992 772		-	97.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	10.06.2015	23.06.2017	27 339 690		-	98.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.06.2015	23.06.2017	27 992 120		-	98.210	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.684%	USD	1'000.00	23.06.2015	23.06.2017	27 992 231		-	98.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Peugeot	EUR	1'000.00	26.06.2015	23.06.2017	28 370 916		-	99.680	100.000		0.000	Y
Protection Participation on EUR/USD	EUR	1'000.00	23.06.2016	23.06.2017	32 829 414		-	90.000	90.000		0.000	Y
Protection Participation on EUR/USD	USD	1'000.00	23.06.2016	23.06.2017	32 829 415		-	89.338	90.000		0.000	Y
5.6 % Reverse Convertible on Xerox Corp	USD	1'000.00	23.06.2016	23.06.2017	31 524 276		-	100.000	100.000	23.06.	7.550	Y
4 1/2 % Reverse Convertible on Constellation Brd-A	USD	1'000.00	23.06.2016	23.06.2017	31 524 278		-	100.000	100.000	23.06.	7.550	Y
5.1 % Reverse Convertible on Eastman Chemical	USD	1'000.00	23.06.2016	23.06.2017	31 524 277		-	100.000	100.000	23.06.	7.550	Y
Protection Participation on USD/CHF	USD	1'000.00	23.06.2016	23.06.2017	32 829 412		-	89.338	90.000		0.000	Y
8 3/4 % (3.49 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.12.2014	26.06.2017	25 924 181		-	100.000	100.000	26.06.	6.270	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.06.2015	26.06.2017	27 992 940		-	98.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.06.2015	26.06.2017	27 992 912		-	98.100	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	100.00	25.06.2015	26.06.2017	28 370 797		-	98.180	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	25.06.2015	26.06.2017	28 370 814		-	99.740	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on GBP/CHF	USD	1'000.00	24.06.2016	26.06.2017	32 829 537		-	99.250	100.000		0.000	Y
Protection Participation on XAU/USD Fixing	USD	1'000.00	24.06.2016	26.06.2017	32 829 542		-	88.880	90.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	1'044'890.00	22.06.2016	29.06.2017	31 524 269		-	99.130	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	27.12.2013	30.06.2017	22 226 714		-	97.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Twitter	USD	1'000.00	23.06.2015	30.06.2017	28 370 928		-	98.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	30.06.2015	30.06.2017	27 992 804		-	97.780	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	03.07.2014	03.07.2017	24 204 914		-	95.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.07.2015	03.07.2017	27 992 304		-	98.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	GBP	1'000.00	03.07.2015	03.07.2017	27 992 920		-	97.700	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.07.2015	03.07.2017	27 992 282		-	98.200	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	04.04.2016	04.07.2017	31 185 386		-	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	18.07.2013	05.07.2017	21 385 652		-	95.340	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate 2013-06.07.17 on Equities	GBP	1'000.00	06.01.2014	06.07.2017	23 092 652		-	94.560	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	GBP	50'000.00	29.06.2016	06.07.2017	31 524 306		-	99.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Bank of China -H-	HKD	1'000'000.00	29.06.2016	06.07.2017	31 524 307		-	99.170	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	07.07.2014	07.07.2017	24 204 918		-	97.120	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	07.07.2015	07.07.2017	28 371 027		-	99.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	08.07.2015	07.07.2017	28 370 920		-	97.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.592%	USD	1'000.00	03.07.2015	10.07.2017	28 370 953		-	98.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.642%	USD	1'000.00	08.07.2015	10.07.2017	27 992 284		-	98.240	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.07.2015	10.07.2017	27 992 327		-	98.190	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	10.07.2015	10.07.2017	28 371 080		-	99.760	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	10.07.2015	10.07.2017	28 371 026		-	98.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Silber 1 Uz	USD	1'000.00	08.07.2016	10.07.2017	32 829 602		-	99.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Barc iPath ETN 19-A	USD	1'000.00	13.06.2016	11.07.2017	32 339 405		-	99.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.07.2016	11.07.2017	31 524 723		-	99.200	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	JPY	46'493'000.00	04.07.2016	11.07.2017	31 524 702		-	100.000	100.000		0.000	Y
5.1 % Reverse Convertible on Helvetia Hldg N	CHF	1'000.00	12.07.2016	12.07.2017	32 339 383		-	100.000	100.000			N
10.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung										10.01.	0.000	
10.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung										10.01.	0.000	
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	13.07.2015	13.07.2017	28 371 015		-	97.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.07.2015	13.07.2017	27 992 329		-	98.190	100.000		0.000	Y
11.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.725%												
Bonus Certificate on Equities	CHF	1'000.00	14.07.2014	14.07.2017	24 565 004		-	99.640	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.07.2015	14.07.2017	27 992 279		-	98.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.07.2015	14.07.2017	28 371 037		-	98.360	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.07.2015	14.07.2017	28 371 036		-	99.760	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Bank of China -H-	HKD	2'000'000.00	07.07.2016	14.07.2017	31 524 720		-	99.200	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Funds	USD	1'000.00	17.07.2014	17.07.2017	24 564 905		-	97.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	15.07.2015	17.07.2017	28 781 804		-	99.740	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	18.07.2013	18.07.2017	21 674 825		-	95.380	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	04.08.2014	18.07.2017	24 565 091		-	96.990	100.000		0.000	Y
13.4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.07.2016	18.07.2017	32 339 535		-	100.000	100.000	18.07.	6.950	Y
10.71 % Reverse Convertible on CS Group N	CHF	1'000.00	18.07.2016	18.07.2017	32 339 534		-	100.000	100.000	18.07.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.04.2016	20.07.2017	31 185 459		-	99.030	100.000		0.000	Y
16.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.876%												
16.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
17.48 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.07.2016	20.07.2017	32 339 388		-	100.000	100.000	20.07.	0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	21.07.2014	21.07.2017	24 564 999		-	94.900	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	21.07.2014	21.07.2017	24 564 998		-	96.770	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	23.07.2014	24.07.2017	24 564 933		-	98.840	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	24.07.2014	24.07.2017	24 564 932		-	98.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	08.07.2015	24.07.2017	28 371 003		-	97.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.07.2016	24.07.2017	32 339 529		-	99.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.07.2016	24.07.2017	32 339 528		-	99.280	100.000		0.000	Y
20.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.288%												
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.07.2016	24.07.2017	33 244 675		-	99.230	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	04.08.2014	25.07.2017	24 565 054		-	96.850	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	04.08.2014	25.07.2017	24 565 053		-	96.830	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	04.08.2014	25.07.2017	24 565 057		-	96.850	100.000		0.000	Y
13.9 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.07.2016	26.07.2017	32 829 457		-	100.000	100.000	26.07.	7.470	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.07.2015	27.07.2017	28 370 973		-	98.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.07.2015	27.07.2017	27 992 436		-	99.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.07.2016	28.07.2017	32 829 416		-	99.230	100.000		0.000	Y
24.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.362%												
5.51 % (10.5 % p.a.) Reverse Convertible on Engie	EUR	1'000.00	19.01.2017	28.07.2017	35 135 205		-	100.000	100.000	28.07.	0.000	Y
5.51 % (10.5 % p.a.) Reverse Convertible on Biogen	USD	1'000.00	19.01.2017	28.07.2017	35 135 206		-	100.000	100.000	28.07.	6.650	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	31.01.2014	31.07.2017	22 226 743		-	97.180	100.000		0.000	Y
Capital Protection-Cert. on Basket	USD	1'000.00	29.07.2014	31.07.2017	24 565 126		-	88.920	92.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	31.07.2014	31.07.2017	24 564 978		-	96.690	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	31.07.2014	31.07.2017	24 565 199		-	95.070	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	07.08.2014	31.07.2017	24 565 111		-	95.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.04.2015	31.07.2017	27 339 621		-	98.180	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	31.07.2015	31.07.2017	28 781 898		-	98.150	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Commodities	USD	1'000.00	22.07.2016	31.07.2017	33 244 680		-	99.230	100.000		0.000	Y
Worst of Bonus Certificate on Equities	USD	200'000.00	01.08.2014	01.08.2017	24 565 149		-	96.630	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	01.08.2014	01.08.2017	24 565 202		-	96.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on S&P GSCI Crd OilER	EUR	1'000.00	01.02.2016	01.08.2017	29 348 034		-	100.000	100.000		0.000	Y
8.32 % Reverse Convertible on Volkswagen Vz	EUR	1'000.00	01.08.2016	01.08.2017	32 829 504		-	100.000	100.000	01.08.	0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Equities	HKD	50'000.00	26.07.2016	02.08.2017	32 339 538		-	99.190	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	50'000.00	26.07.2016	02.08.2017	32 339 539		-	99.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.02.2016	03.08.2017	30 040 807		-	98.740	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.562%	USD	1'000.00	27.07.2016	03.08.2017	32 829 481		-	99.160	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	27.07.2016	03.08.2017	32 339 551		-	99.230	100.000		0.000	Y
7 3/4 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.08.2016	04.08.2017	33 244 748		-	100.000	100.000	04.08.	0.000	Y
7.2 % Reverse Convertible on Michael Kors	USD	1'000.00	04.08.2016	04.08.2017	33 244 745		-	100.000	100.000	04.08.	8.360	Y
11 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.08.2016	04.08.2017	33 244 747		-	100.000	100.000	04.08.	8.360	Y
9.2 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.08.2016	04.08.2017	33 244 746		-	100.000	100.000	04.08.	8.360	Y
7.31 % (7.39 % p.a.) Reverse Convertible on Celgene Corp	CHF	1'000.00	08.08.2016	04.08.2017	30 041 230		-	100.000	100.000	04.08.	0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	07.02.2014	07.08.2017	22 226 759		-	97.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	05.08.2015	07.08.2017	28 370 972		-	97.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 6.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	08.02.2016	08.08.2017	30 040 828		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ICBC-H	HKD	1'000.00	02.08.2016	09.08.2017	32 829 450		-	99.160	100.000		0.000	Y
10.81 % Reverse Convertible on Herbalife	CHF	1'000.00	09.08.2016	09.08.2017	33 244 778		-	100.000	100.000	09.08.	0.000	Y
11 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.08.2016	09.08.2017	33 244 777		-	100.000	100.000	09.08.	8.110	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	100'000.00	03.08.2016	10.08.2017	32 829 470		-	99.180	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.07.2015	11.08.2017	28 781 786		-	98.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 10.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.991%	EUR	1'000.00	14.08.2015	14.08.2017	28 370 996		-	99.820	100.000		0.000	Y
Protection Participation on XAU/USD Fixing	USD	1'000.00	12.08.2016	14.08.2017	33 245 076		-	89.220	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.08.2016	16.08.2017	32 829 526		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	17.08.2015	17.08.2017	28 782 004		-	98.090	100.000		0.000	Y
6 1/2 % Reverse Convertible on 10 Year USD ISDAFIX-Swap	USD	1'000.00	17.08.2016	17.08.2017	33 597 418		-	100.000	100.000	17.08.	8.960	Y
6.4 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.08.2016	17.08.2017	33 244 853		-	100.000	100.000	17.08.	0.000	Y
6.4 % Reverse Convertible on TevaPharmInd Sp ADR	USD	1'000.00	17.08.2016	17.08.2017	33 244 856		-	100.000	100.000	17.08.	8.870	Y
Underlying Tracker on Commodities	USD	1'000.00	18.05.2016	18.08.2017	32 339 437		-	99.050	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	18.05.2016	18.08.2017	31 185 625		-	99.050	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	18.05.2016	18.08.2017	31 185 623		-	99.050	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Funds	USD	1'000.00	18.05.2016	18.08.2017	32 339 436		-	99.050	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	18.05.2016	18.08.2017	31 185 627		-	99.050	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	18.05.2016	18.08.2017	31 185 626		-	99.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 16.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	04.08.2016	18.08.2017	33 244 753		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	USD	10'000.00	11.08.2016	18.08.2017	33 244 731		-	99.130	100.000		0.000	Y
(2 % Min.) with credit risk floating rate	USD	1'000.00	21.02.2012	21.08.2017	14 911 757		-	82.430	100.000	21.02. 21.08.	40.780 19.390	Y
Outperformance-Cert. on Swiss Life Holding	CHF	1'000.00	21.08.2012	21.08.2017	19 089 392		-	98.460	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	21.08.2014	21.08.2017	24 565 164		-	96.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.08.2015	21.08.2017	28 370 994		-	99.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.08.2015	21.08.2017	28 370 995		-	99.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.08.2015	21.08.2017	28 370 993		-	99.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.08.2015	21.08.2017	28 781 998		-	98.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.684%	GBP	1'000.00	23.05.2016	23.08.2017	32 339 438		-	99.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	23.08.2016	23.08.2017	33 597 442		-	100.000	100.000	23.08.	8.490	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	23.08.2016	23.08.2017	33 597 443		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.08.2016	23.08.2017	33 597 441		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	28.11.2016	23.08.2017	34 443 935		-	100.000	100.000		0.000	N
Capital Protection-Cert. on Basket	USD	1'000.00	24.08.2012	24.08.2017	19 271 131		-	95.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.08.2015	24.08.2017	28 370 982		-	98.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 23.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.476%	USD	1'000.00	24.08.2015	24.08.2017	27 992 568		-	98.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.06.2015	25.08.2017	27 339 687		-	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.06.2015	25.08.2017	27 339 688		-	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.06.2015	25.08.2017	27 339 686		-	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.06.2015	25.08.2017	27 992 891		-	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	19.06.2015	25.08.2017	27 992 897		-	97.720	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Basket	HKD	100'000.00	18.08.2016	25.08.2017	33 244 800		-	99.180	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	100'000.00	18.08.2016	25.08.2017	33 244 804		-	99.180	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	28.08.2014	28.08.2017	24 565 188		-	96.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Fiat Chrysler Auto	EUR	1'000.00	29.02.2016	29.08.2017	31 524 379		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Tiffany & Co	USD	1'000.00	29.02.2016	29.08.2017	31 524 382		-	98.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	AUD	50'000.00	22.08.2016	29.08.2017	33 244 829		-	98.080	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	50'000.00	22.08.2016	29.08.2017	33 244 831		-	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Whole Foods Market	USD	1'000.00	29.08.2016	29.08.2017	33 245 036		-	100.000	100.000	29.08.	8.800	Y
5.1 % Reverse Convertible on Roy.Philips	EUR	1'000.00	29.08.2016	29.08.2017	33 245 043		-	100.000	100.000	29.08.	0.000	Y
6 3/4 % Reverse Convertible on Celgene Corp	USD	1'000.00	29.08.2016	29.08.2017	33 245 021		-	100.000	100.000	29.08.	8.520	Y
5.6 % Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	30.08.2016	30.08.2017	33 245 056		-	100.000	100.000	30.08.	8.820	Y
8.2 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.08.2016	30.08.2017	33 245 047		-	100.000	100.000	30.08.	8.820	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.08.2015	31.08.2017	28 781 840		-	98.260	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	100'000.00	24.08.2016	31.08.2017	33 244 852		-	99.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.03.2016	01.09.2017	31 524 364		-	98.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Twitter	CHF	1'000.00	03.03.2016	01.09.2017	31 524 399		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.08.2016	01.09.2017	33 245 011		-	99.100	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Hermes Intl	USD	1'000.00	01.09.2016	01.09.2017	33 597 600		-	89.170	90.000		0.000	Y
Protection Participation on Gold 1 Uz	USD	1'000.00	01.09.2016	01.09.2017	33 597 598		-	88.647	90.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	04.09.2014	04.09.2017	24 565 529		-	95.550	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	04.09.2014	04.09.2017	24 565 528		-	95.550	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	05.09.2014	05.09.2017	24 565 530		-	96.690	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	05.09.2014	05.09.2017	24 565 220		-	96.600	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	05.09.2014	05.09.2017	24 565 167		-	96.600	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	05.09.2014	05.09.2017	24 565 531		-	96.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.03.2015	05.09.2017	26 674 838		-	99.840	100.000		0.000	Y
9.38 % (3 3/4 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.03.2015	06.09.2017	26 673 901		-	100.000	100.000	06.09.	3.410	Y
Reverse Convertible on Ford Motor 3.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.078%	USD	1'000.00	29.08.2016	06.09.2017	33 245 028		-	99.080	100.000		0.000	Y
7.88 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.09.2016	06.09.2017	33 245 163		-	100.000	100.000	06.09.	9.060	Y
12.1 % Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	06.03.2017	06.09.2017	35 551 060		-	100.000	100.000	06.06. 06.09.	3.011 2.980	N
Outperformance Certificate on Zurich Insur GrpN	CHF	1'000.00	07.09.2012	07.09.2017	19 271 319		-	98.510	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on OCBC	SGD	1'010'659.00	30.08.2016	07.09.2017	33 244 915		-	98.730	100.000		0.000	Y
7.8 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	07.09.2016	07.09.2017	33 597 396		-	100.000	100.000	07.09.	3.990	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	08.09.2015	08.09.2017	28 371 042		-	97.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.454%	USD	1'000.00	08.09.2015	08.09.2017	27 992 625		-	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.752%	USD	1'000.00	08.09.2015	08.09.2017	27 992 623		-	98.400	100.000	06.06.	0.03351	Y
Reverse Convertible on Tiffany & Co	USD	1'000.00	08.03.2016	08.09.2017	31 524 476		-	98.800	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	SGD	50'000.00	31.08.2016	08.09.2017	33 244 934		-	98.700	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	10'000.00	01.09.2016	08.09.2017	33 245 001		-	99.230	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Continental	USD	100.00	01.09.2016	08.09.2017	33 244 670		-	99.220	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Amazon.Com	USD	100.00	01.09.2016	08.09.2017	33 244 669		-	99.220	100.000		0.000	Y
5.33 % (7.1 % p.a.) Reverse Convertible on K+S N	GBP	1'000.00	08.12.2016	08.09.2017	34 540 902		-	100.000	100.000	08.09.	6.280	Y
Multi Barrier Reverse Convertible on basket	EUR	1'000.00	11.09.2012	11.09.2017	19 271 423		-	95.760	100.000		0.000	Y
Capital Protection-Cert. on Equities	USD	1.00	11.09.2012	11.09.2017	19 271 403		-	96.140	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	11.03.2014	11.09.2017	23 092 883		-	97.590	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	11.09.2014	11.09.2017	24 205 127		-	96.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.09.2015	11.09.2017	28 781 833		-	99.840	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	SGD	50'000.00	01.09.2016	11.09.2017	33 245 004		-	98.740	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	SGD	50'000.00	01.09.2016	11.09.2017	33 245 002		-	98.730	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	100'000.00	02.09.2016	11.09.2017	33 245 014		-	99.190	100.000		0.000	Y
Express-Cert. on Equities	GBP	1'000.00	12.09.2012	12.09.2017	18 961 687		-	95.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Fiat Chrysler Auto	CHF	1'000.00	10.03.2016	12.09.2017	31 524 489		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 10.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.78%	USD	1'000.00	31.08.2016	12.09.2017	33 245 044		-	99.060	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5 % (4.931507 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	50'000.00	07.09.2016	12.09.2017	33 597 582		-	100.000	100.000	12.09.	452.36	Y
5 % (9.863014 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	50'000.00	08.09.2016	13.09.2017	33 597 590		-	100.000	100.000	13.09.	444.27	Y
4.8 % Reverse Convertible on BMW	EUR	1'000.00	13.09.2016	13.09.2017	33 597 388		-	100.000	100.000	13.09.	0.000	Y
5 % Reverse Convertible on ams	CHF	1'000.00	13.09.2016	13.09.2017	33 597 389		-	100.000	100.000	13.09.	0.000	Y
6.55 % Reverse Convertible on Renault	EUR	1'000.00	13.09.2016	13.09.2017	33 597 387		-	100.000	100.000	13.09.	0.000	Y
5.78 % (5.8 % p.a.) Reverse Convertible on Allergan	USD	1'000.00	14.09.2016	13.09.2017	33 597 383		-	100.000	100.000	13.09.	14.980	Y
5.78 % (5.8 % p.a.) Reverse Convertible on General Motors	USD	1'000.00	14.09.2016	13.09.2017	33 597 386		-	100.000	100.000	13.09.	14.980	Y
4.59 % (4.6 % p.a.) Reverse Convertible on Boeing Co	USD	1'000.00	14.09.2016	13.09.2017	33 597 385		-	100.000	100.000	13.09.	14.980	Y
6.68 % (6.7 % p.a.) Reverse Convertible on Whole Foods Market	USD	1'000.00	14.09.2016	13.09.2017	33 597 384		-	100.000	100.000	13.09.	14.980	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.08.2015	15.09.2017	28 370 935		-	98.220	100.000		0.000	Y
3.48 % Reverse Convertible on Equities 14.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.09.2014	18.09.2017	24 205 168		-	100.000	100.000	16.01. 16.02. 16.03. 18.04. 16.06. 14.07.	0.04166 0.04166 0.04166 0.04166 0.04166 0.04166	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.03.2015	18.09.2017	26 673 940		-	97.180	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.09.2015	18.09.2017	28 781 943		-	98.360	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.09.2015	18.09.2017	28 781 942		-	98.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 16.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.09.2015	18.09.2017	27 992 706		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 16.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.992%	EUR	1'000.00	18.09.2015	18.09.2017	27 992 704		-	99.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.09.2015	19.09.2017	28 781 945		-	98.300	100.000		0.000	Y
11.68 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.09.2016	19.09.2017	33 597 648		-	100.000	100.000	19.09.	9.140	Y
6 1/2 % Reverse Convertible on 10Y Swap	USD	1'000.00	19.09.2016	19.09.2017	33 851 149		-	100.000	100.000	19.09.	9.240	Y
12.84 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.09.2016	19.09.2017	33 597 645		-	100.000	100.000	19.09.	9.140	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	100'000.00	13.09.2016	20.09.2017	33 597 361		-	99.170	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Wynn Macau	USD	500'000.00	13.09.2016	20.09.2017	33 597 720		-	99.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	500'000.00	14.09.2016	21.09.2017	33 597 395		-	99.180	100.000		0.000	Y
11 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.09.2016	21.09.2017	33 597 682		-	100.000	100.000	21.09.	0.000	Y
Express-Cert. on Equities	GBP	500.00	27.09.2012	22.09.2017	19 443 386		-	94.690	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	500'000.00	15.09.2016	22.09.2017	33 597 461		-	99.210	100.000		0.000	Y
6 1/2 % Reverse Convertible on USD 10Y Swap	USD	1'000.00	22.09.2016	22.09.2017	33 851 209		-	100.000	100.000	22.09.	9.100	Y
9 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.09.2016	22.09.2017	33 597 697		-	100.000	100.000	22.09.	8.910	Y
Express Certificate on Equities 7.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.338%	USD	1'000.00	19.09.2014	25.09.2017	24 205 133		-	96.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.09.2014	25.09.2017	24 565 719		-	96.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	25.09.2014	25.09.2017	24 205 213		-	96.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Mellanox Technologi 23.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.51%	USD	1'000.00	25.03.2016	25.09.2017	30 041 098		-	98.740	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Las Vegas Sands	USD	50'000.00	16.09.2016	25.09.2017	33 597 490		-	99.050	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	100'000.00	19.09.2016	25.09.2017	33 597 479		-	99.170	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	50'000.00	19.09.2016	25.09.2017	33 597 486		-	99.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	19.09.2016	26.09.2017	33 597 496		-	100.000	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.09.2016	26.09.2017	33 597 745		-	100.000	100.000	26.09.	9.020	Y
Protection Participation on EUR/USD	USD	1'000.00	26.09.2016	26.09.2017	33 851 335		-	89.160	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ABB N	EUR	16.66	05.07.2016	29.09.2017	32 829 587		-	100.000	100.000		0.000	Y
7.2 % Reverse Convertible on NASDAQ 100	USD	1'000.00	29.09.2016	29.09.2017	33 851 364		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.10.2014	02.10.2017	24 205 261		-	96.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	02.10.2014	02.10.2017	24 205 273		-	95.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.10.2014	02.10.2017	24 565 713		-	96.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	02.10.2014	02.10.2017	25 444 953		-	96.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.439%	USD	1'000.00	02.10.2015	02.10.2017	28 781 940		-	98.460	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 29.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.847%	GBP	1'000.00	02.10.2015	02.10.2017	28 781 984		-	98.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Lvmh	EUR	127.81	01.08.2016	02.10.2017	33 244 708		-	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on USD/CHF	CHF	1'000.00	30.09.2016	02.10.2017	33 851 367		-	90.000	90.000		0.000	Y
Protection Participation on USD/CHF	USD	1'000.00	30.09.2016	02.10.2017	33 851 368		-	89.144	90.000		0.000	Y
8.09 % (8.11 % p.a.) Reverse Convertible on Equities 2.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	03.10.2016	02.10.2017	33 597 757		-	100.000	100.000	02.03.	6.528	Y
5.99 % (6 % p.a.) Reverse Convertible on Equities 3.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	03.10.2016	02.10.2017	33 597 758		-	100.000	100.000	03.01.	4.075	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	03.10.2014	03.10.2017	24 565 190		-	99.250	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	AUD	1'000.00	03.10.2014	03.10.2017	25 445 043		-	91.350	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on HSBC Hldg	HKD	1'000.00	23.09.2016	03.10.2017	33 597 618		-	99.180	100.000		0.000	Y
5.05 % Reverse Convertible on Starbucks	USD	1'000.00	03.10.2016	03.10.2017	33 851 078		-	100.000	100.000	03.10.	9.250	Y
(1/2 % Min.) Magnet-Cert. with credit risk Einmalverzinsung Bondfloor	CHF	1'000.00	07.09.2012	05.10.2017	18 961 838		-	98.790	100.000	05.10. 05.10.	5.000 12.100	N
(0.55 % min.) with reference bond floating rate	CHF	1'000.00	07.09.2012	05.10.2017	18 961 839		-	100.000	100.000	05.01. 05.04. 05.07. 05.10.	1.405 1.375 1.390 0.08333	N
(1 1/4 % min.) with reference bond floating rate	EUR	1'000.00	07.09.2012	05.10.2017	18 961 840		-	100.000	100.000	05.01. 05.04. 05.07. 05.10.	3.420 3.345 3.457 3.618	N
Reverse Convertible on Linde	EUR	115.88	04.08.2016	05.10.2017	33 244 944		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.773%	USD	1'000.00	26.09.2016	06.10.2017	33 597 760		-	99.040	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	100'000.00	28.09.2016	06.10.2017	33 597 674		-	99.140	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Swiss Re N	CHF	1'000.00	10.10.2014	10.10.2017	24 205 333		-	99.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	AUD	1'000.00	10.10.2014	10.10.2017	25 445 032		-	91.540	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	08.04.2016	10.10.2017	31 524 580		-	98.870	100.000		0.000	Y
8.35 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.10.2016	10.10.2017	33 851 214		-	100.000	100.000	10.10.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.10.2016	11.10.2017	33 851 124		-	99.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	12.10.2015	12.10.2017	28 782 105		-	98.170	100.000		0.000	Y
5 3/4 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.10.2016	12.10.2017	33 851 250		-	100.000	100.000	12.10.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.538%	USD	1'000.00	14.10.2014	13.10.2017	25 445 049		-	96.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	13.04.2015	13.10.2017	27 339 449		-	97.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.04.2015	13.10.2017	26 674 073		-	99.750	100.000		0.000	Y
6.51 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.10.2016	13.10.2017	33 851 249		-	100.000	100.000	13.10.	9.350	Y
6 1/4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.10.2016	13.10.2017	33 851 253		-	100.000	100.000	13.10.	9.350	Y
6 1/4 % Reverse Convertible on ArcelorMittal Reg	USD	1'000.00	13.10.2016	13.10.2017	33 851 252		-	100.000	100.000	13.10.	9.350	Y
7 % (7.14 % p.a.) Reverse Convertible on Equities 15.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	20.10.2016	13.10.2017	33 851 276		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.10.2014	16.10.2017	24 565 597		-	96.540	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.04.2015	16.10.2017	27 339 575		-	97.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.10.2016	16.10.2017	33 851 226		-	99.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.809%	USD	1'000.00	11.10.2016	16.10.2017	33 851 229		-	99.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	11.10.2016	16.10.2017	33 851 225		-	99.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	11.10.2016	16.10.2017	33 851 228		-	99.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.614%	USD	1'000.00	11.10.2016	16.10.2017	33 851 227		-	99.050	100.000		0.000	Y
3.38 % (1.118785 % p.a.) Reverse Convertible on Richemont N	USD	1'000.00	14.04.2016	17.10.2017	31 524 634		-	100.000	100.000	17.10.	11.690	Y
18.84 % Reverse Convertible on Equities 13.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	17.10.2016	17.10.2017	33 851 287		-	100.000	100.000	13.01.	0.000	N
8 1/2 % Reverse Convertible on ESTXBnk EUR P	EUR	1'000.00	18.10.2016	18.10.2017	32 829 651		-	100.000	100.000	18.10.	0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
6 % Reverse Convertible on Best Buy	USD	1'000.00	18.10.2016	18.10.2017	33 851 311		-	100.000	100.000	18.10.	9.710	Y
6 3/4 % Reverse Convertible on Vertex Pharmaceutic	GBP	1'000.00	18.10.2016	18.10.2017	33 851 312		-	100.000	100.000	18.10.	6.980	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	18.10.2016	18.10.2017	33 851 313		-	100.000	100.000	18.10.	6.980	Y
Express Cert. on Equities	EUR	1'000.00	19.10.2012	19.10.2017	19 748 024		-	95.570	100.000		0.000	Y
9 3/4 % Reverse Convertible on ArcelorMittal Reg	EUR	1'000.00	19.10.2016	19.10.2017	33 851 374		-	100.000	100.000	19.10.	0.000	Y
Protection Participation on Gold 1 Uz	USD	1'000.00	20.10.2016	20.10.2017	34 080 830		-	89.110	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	23.10.2014	23.10.2017	24 205 384		-	96.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.10.2014	23.10.2017	24 205 394		-	96.970	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	100'000.00	14.10.2016	23.10.2017	33 851 127		-	99.180	100.000		0.000	Y
10.2 % Reverse Convertible on Equities 19.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	24.10.2016	24.10.2017	34 080 731		-	100.000	100.000	19.04.	0.000	N
Capital Protection with Reference Bond on Basket	EUR	1'000.00	30.05.2012	25.10.2017	18 426 027		-	84.260	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	500'000.00	21.10.2016	25.10.2017	33 851 285		-	99.150	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	500'000.00	21.10.2016	25.10.2017	33 851 286		-	99.150	100.000		0.000	Y
Structured Note on Indices	USD	50'000.00	19.10.2016	26.10.2017	34 080 768		-	94.070	95.000		0.000	Y
11 % (4.4 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.04.2015	27.10.2017	26 674 225		-	100.000	100.000	27.10.	2.310	Y
Underlying Tracker on Basket	USD	1'000.00	21.07.2016	27.10.2017	32 339 579		-	99.010	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Vivendi 28.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.925%	EUR	1'000.00	29.10.2013	30.10.2017	22 406 589		-	96.210	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	30.10.2014	30.10.2017	25 822 901		-	96.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Banco Santander	EUR	1'000.00	30.10.2014	30.10.2017	25 445 244		-	99.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	30.04.2015	30.10.2017	27 339 635		-	97.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.04.2015	30.10.2017	27 339 337		-	97.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.10.2015	30.10.2017	28 781 983		-	98.540	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	30.10.2015	30.10.2017	28 782 211		-	98.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.07.2016	31.10.2017	32 829 574		-	99.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Bank of China - H-	HKD	6'000'000.00	27.10.2016	31.10.2017	33 851 382		-	99.130	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Royal Dutch Shell-A	GBP	1'000.00	31.10.2016	31.10.2017	34 080 519		-	100.000	100.000	31.10.	5.420	Y
6 1/2 % Reverse Convertible on 10Y Swap	USD	1'000.00	02.11.2016	31.10.2017	34 080 880		-	100.000	100.000	31.10.	15.460	Y
Underlying Tracker on Equities 2.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	JPY	5'000'000.00	28.10.2016	02.11.2017	34 080 832		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities 2.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	50'000.00	28.10.2016	02.11.2017	34 080 831		-	100.000	100.000		0.000	Y
Capital Protection-Cert. on Basket	USD	1'000.00	25.10.2012	03.11.2017	19 538 604		-	95.550	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.11.2016	03.11.2017	34 080 609		-	100.000	100.000	03.11.	9.900	Y
6.2 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.11.2016	03.11.2017	34 080 615		-	100.000	100.000	03.11.	0.000	Y
14 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.11.2016	03.11.2017	34 080 610		-	100.000	100.000	03.11.	9.900	Y
10 1/2 % Reverse Convertible on First Solar	USD	1'000.00	03.11.2016	03.11.2017	34 080 612		-	100.000	100.000	03.11.	9.900	Y
14 1/2 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.11.2016	03.11.2017	34 080 611		-	100.000	100.000	03.11.	9.900	Y
Express-Cert. on Basket	GBP	1'000.00	07.11.2012	07.11.2017	19 538 648		-	94.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on K+S N	CHF	1'000.00	10.11.2015	10.11.2017	20 454 953		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 10.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.759%	USD	1'000.00	31.10.2016	10.11.2017	34 080 523		-	99.000	100.000		0.000	Y
5.4 % (5.297003 % p.a.) Reverse Convertible on USD 10Y Swap	USD	50'000.00	03.11.2016	10.11.2017	34 080 885		-	100.000	100.000	10.11.	486.61	Y
Underlying Tracker on China Mobile	USD	500'000.00	07.11.2016	10.11.2017	34 080 502		-	99.020	100.000		0.000	Y
5 1/2 % Reverse Convertible on Deutsche Post N	EUR	1'000.00	10.11.2016	10.11.2017	34 080 684		-	100.000	100.000	10.11.	0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	GBP	1'000.00	04.11.2014	13.11.2017	24 205 420		-	96.080	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 11.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.264%	SGD	1'000.00	13.11.2014	13.11.2017	25 822 906		-	96.690	100.000	11.04.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.05.2015	13.11.2017	27 991 981		-	99.680	100.000		0.000	Y
10.25 % Reverse Convertible on Tesla Motors	USD	1'000.00	14.11.2016	14.11.2017	34 080 986		-	100.000	100.000	14.11.	9.520	Y
7.75 % Reverse Convertible on Air France - KLM	EUR	1'000.00	14.11.2016	14.11.2017	34 080 987		-	100.000	100.000	14.11.	0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Societe Generale	EUR	1'000.00	14.11.2016	14.11.2017	34 080 988		-	100.000	100.000	14.11.	0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
12.00 % Reverse Convertible on Herbalife	USD	1'000.00	14.11.2016	14.11.2017	34 080 985		-	100.000	100.000	14.11.	9.520	Y
6.3 % (6.34 % p.a.) Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	10.03.2017	14.11.2017	35 914 155		-	100.000	100.000	14.11.	10.140	Y
Express-Cert. on Equities	USD	1'000.00	15.11.2012	15.11.2017	19 538 490		-	96.240	100.000		0.000	Y
Express-Cert. on basket of indices	GBP	1'000.00	15.11.2012	15.11.2017	19 538 491		-	95.100	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Netflix	USD	500'000.00	08.11.2016	15.11.2017	34 080 932		-	98.990	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.11.2016	15.11.2017	34 080 976		-	99.040	100.000		0.000	Y
15.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.152%												
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.11.2015	17.11.2017	29 348 176		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.08.2016	17.11.2017	33 597 415		-	98.850	100.000		0.000	Y
13.00 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	17.11.2016	17.11.2017	34 443 671		-	100.000	100.000	17.11.	5.750	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.11.2016	17.11.2017	34 443 745		-	100.000	100.000	17.11.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	19.11.2014	20.11.2017	25 924 021		-	96.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.11.2014	20.11.2017	25 822 907		-	96.480	100.000		0.000	Y
19.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.249%												
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.02.2016	20.11.2017	31 185 279		-	98.560	100.000		0.000	Y
6.72 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	21.11.2016	21.11.2017	34 443 706		-	100.000	100.000	21.11.	0.000	Y
6.20 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.11.2016	21.11.2017	34 443 655		-	100.000	100.000	21.11.	10.020	Y
Protection Participation on iShs FTSE A50	USD	50'000.00	21.11.2016	21.11.2017	34 443 703		-	94.020	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Weatherford Int	CHF	1'000.00	22.08.2016	22.11.2017	33 244 903		-	100.000	100.000		0.000	Y
20.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung												
7.25 % Reverse Convertible on Alexion Pharm	USD	1'000.00	22.11.2016	22.11.2017	34 443 856		-	100.000	100.000	22.11.	10.220	Y
Express Certificate on Banco Santander	EUR	1'000.00	23.05.2014	23.11.2017	24 205 701		-	97.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Givaudan N	CHF	1'921.00	02.11.2016	24.11.2017	34 080 590		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.11.2014	27.11.2017	25 923 852		-	96.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.11.2014	28.11.2017	25 445 259		-	99.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	28.05.2015	28.11.2017	26 674 478		-	97.470	100.000		0.000	Y
25.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.293%												
5.50 % Reverse Convertible on Credit Agricole	USD	1'000.00	28.11.2016	28.11.2017	34 443 878		-	100.000	100.000	28.11.	10.230	Y
8.00 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.11.2016	28.11.2017	34 443 902		-	100.000	100.000	28.11.	10.330	Y
5.00 % Reverse Convertible on TevaPharmInd Sp ADR	USD	1'000.00	28.11.2016	28.11.2017	34 443 877		-	100.000	100.000	28.11.	10.230	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	29.05.2015	29.11.2017	27 992 795		-	97.180	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	29.05.2015	29.11.2017	27 992 794		-	97.180	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.11.2016	29.11.2017	34 443 626		-	98.980	100.000		0.000	Y
23.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.713%												
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	17.11.2016	29.11.2017	34 443 617		-	99.000	100.000		0.000	Y
1.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.765%												
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.11.2016	29.11.2017	34 443 627		-	98.970	100.000		0.000	Y
23.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.701%												
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.11.2016	29.11.2017	34 443 675		-	98.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.11.2016	29.11.2017	34 443 676		-	98.980	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	17.11.2016	29.11.2017	34 443 618		-	99.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on China Coal Energ-H-	USD	100'000.00	22.11.2016	29.11.2017	34 443 853		-	99.010	100.000		0.000	Y
6 % Barrier Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	30.11.2012	30.11.2017	19 538 602		-	95.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.06.2015	01.12.2017	26 674 494		-	97.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.06.2015	01.12.2017	26 674 495		-	97.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.06.2015	01.12.2017	26 674 500		-	97.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.06.2015	04.12.2017	27 992 866		-	99.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.06.2015	04.12.2017	27 992 867		-	99.680	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.05.2016	04.12.2017	31 185 682		-	98.590	100.000		0.000	Y
9 1/2 % (3.8 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.06.2015	05.12.2017	27 992 881		-	100.000	100.000	05.12.	4.380	Y
Underlying Tracker on Sands China 144A/S	HKD	3'000'000.00	02.12.2016	07.12.2017	34 443 912		-	98.710	100.000		0.000	Y
3.5 % Reverse Convertible on Vinci	EUR	1'000.00	07.12.2016	07.12.2017	34 540 887		-	100.000	100.000	07.12.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.02.2017	07.12.2017	35 550 906		-	100.000	100.000	07.12.	0.000	Y
7.5 % Reverse Convertible on E.ON N	EUR	1'000.00	08.12.2016	08.12.2017	34 540 909		-	100.000	100.000	08.12.	0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P 9.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	13.06.2016	13.12.2017	32 339 477		-	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on EUR/USD	EUR	1'000.00	13.12.2016	13.12.2017	34 765 785		-	90.000	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.11.2016	14.12.2017	34 443 624		-	98.960	100.000		0.000	Y
7.01 % Reverse Convertible on Equities 16.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.715%	USD	1'000.00	09.12.2016	14.12.2017	34 540 889		-	100.000	100.000	16.03.	17.678	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	15.06.2015	15.12.2017	28 370 845		-	97.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	15.12.2015	15.12.2017	29 347 793		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.532%	USD	1'000.00	15.09.2016	15.12.2017	33 597 459		-	98.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	18.06.2015	18.12.2017	28 370 846		-	97.250	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 15.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.009%	USD	1'000.00	05.12.2016	19.12.2017	34 540 683		-	98.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 16.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	05.12.2016	19.12.2017	34 540 675		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	50'000.00	14.12.2016	19.12.2017	34 540 876		-	98.910	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities 17.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.12.2016	19.12.2017	34 765 682		-	100.000	100.000	17.01. 16.02. 16.03. 19.04. 17.05. 19.12.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Bca Pop. Milano 16.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	20.09.2016	20.12.2017	33 597 657		-	100.000	100.000		0.000	Y
10.2 % Reverse Convertible on Equities 19.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	5'000.00	21.12.2016	21.12.2017	34 765 637		-	100.000	100.000	19.06.	0.000	N
Reverse Convertible on Hertz Global Hldgs	USD	1'000.00	22.06.2016	22.12.2017	31 524 316		-	98.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.12.2015	26.12.2017	30 497 850		-	97.940	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CITIC	HKD	5'000'000.00	20.12.2016	27.12.2017	34 540 949		-	98.620	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	USD	1'000.00	28.12.2012	28.12.2017	19 539 022		-	95.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	28.12.2015	28.12.2017	29 348 228		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on NQ Mobile Sp ADR-A	USD	1'000.00	28.06.2016	28.12.2017	32 829 404		-	98.800	100.000		0.000	Y
11.65 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.12.2016	28.12.2017	34 901 990		-	100.000	100.000	28.12.	0.000	Y
Express Cert. on Basket	USD	1'000.00	28.12.2012	29.12.2017	19 539 064		-	95.760	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate 2012-29.12.17 on Equities	USD	1'000.00	04.01.2013	29.12.2017	19 538 563		-	95.770	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	29.12.2014	29.12.2017	25 924 229		-	96.510	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	21.11.2016	29.12.2017	34 443 727		-	100.000	100.000		0.000	Y
6.11 % (6.01 % p.a.) Reverse Convertible on Equities 23.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	23.12.2016	29.12.2017	34 765 722		-	100.000	100.000		0.000	Y
6.3 % Reverse Convertible on Glencore	EUR	1'000.00	29.12.2016	29.12.2017	34 902 005		-	100.000	100.000	29.12.	0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Alexion Pharm	EUR	1'000.00	29.12.2016	29.12.2017	34 902 006		-	100.000	100.000	29.12.	0.000	Y
5.2 % Reverse Convertible on Credit Agricole	EUR	1'000.00	29.12.2016	29.12.2017	34 902 004		-	100.000	100.000	29.12.	0.000	Y
5.2 % Reverse Convertible on TevaPharmInd Sp ADR	EUR	1'000.00	29.12.2016	29.12.2017	34 902 003		-	100.000	100.000	29.12.	0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.01.2015	02.01.2018	25 924 242	%	106.150	96.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.12.2014	03.01.2018	25 924 125	%	1.000	96.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 3.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.768%	USD	1'000.00	04.01.2016	04.01.2018	30 497 726		-	97.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.532%	USD	1'000.00	21.12.2016	04.01.2018	34 765 747		-	98.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 4.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	29.12.2016	04.01.2018	34 765 821		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.01.2017	05.01.2018	34 902 028	%	46.910	98.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	08.01.2015	08.01.2018	25 924 159	%	20.030	96.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 6.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	08.01.2016	08.01.2018	29 347 879		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.01.2016	08.01.2018	29 347 890	%	101.930	97.740	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	08.07.2016	08.01.2018	32 339 371		-	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 3.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	08.07.2016	08.01.2018	32 339 369		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.07.2016	08.01.2018	32 339 370	%	102.700	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.10.2016	10.01.2018	33 851 123	%	37.940	98.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.10.2016	10.01.2018	33 851 122	%	37.920	98.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.10.2016	10.01.2018	33 851 125	%	5.850	98.810	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities 11.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	GBP	1'000.00	11.01.2013	11.01.2018	19 538 955		-	94.300	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Gold 1 Uz	USD	1'000.00	12.01.2017	12.01.2018	35 135 317	%	84.460	83.580	85.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	15.07.2015	15.01.2018	28 371 023	%	38.830	97.130	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P 13.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	15.07.2016	15.01.2018	32 829 627		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.206%	USD	1'000.00	13.01.2017	15.01.2018	35 135 323		-	98.990	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Hermes Intl	USD	1'000.00	13.01.2017	15.01.2018	35 135 327	%	79.450	78.660	80.000		0.000	Y
4.59 % (4.6 % p.a.) Reverse Convertible on Wells Fargo	USD	1'000.00	17.01.2017	16.01.2018	34 902 146	%	99.580	100.000	100.000		0.000	Y
6.08 % (6.1 % p.a.) Reverse Convertible on Mellanox Technologi	USD	1'000.00	17.01.2017	16.01.2018	34 902 145	%	99.630	100.000	100.000		0.000	Y
8.58 % (8.6 % p.a.) Reverse Convertible on Vallourec	USD	1'000.00	17.01.2017	16.01.2018	34 902 140	%	72.490	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	USD	1'000.00	17.01.2013	17.01.2018	19 539 020	%	141.790	95.670	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	25.07.2014	17.01.2018	24 564 912	%	97.250	93.920	100.000		0.000	Y
7.5 % Reverse Convertible on Ralph Lauren-A	USD	1'000.00	18.01.2017	18.01.2018	35 135 129	%	107.110	100.000	100.000		0.000	Y
5.9 % Reverse Convertible on Deutsche Bank N	USD	1'000.00	19.01.2017	19.01.2018	35 135 171	%	105.310	100.000	100.000		0.000	Y
8.75 % Reverse Convertible on Ralph Lauren-A	USD	1'000.00	19.01.2017	19.01.2018	35 135 170	%	108.160	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	22.01.2013	22.01.2018	19 539 189	%	19.630	94.770	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	21.01.2015	22.01.2018	26 674 579	%	78.010	96.200	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	21.01.2015	22.01.2018	25 924 298	%	102.740	96.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Vallourec	EUR	1'000.00	05.02.2016	22.01.2018	30 497 979	%	46.340	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.07.2016	22.01.2018	32 339 567	%	102.470	98.830	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	100'000.00	19.01.2017	23.01.2018	34 902 174	%	134.740	98.440	100.000		0.000	Y
6.5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.01.2017	23.01.2018	35 135 247	%	99.480	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	50'000.00	19.01.2017	24.01.2018	34 902 195	%	95.920	98.810	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	50'000.00	20.01.2017	25.01.2018	34 443 797	%	105.760	98.800	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Standard Chartered	HKD	1'000.00	23.01.2017	25.01.2018	34 902 317	%	122.230	98.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	500'000.00	23.01.2017	25.01.2018	34 902 316	%	87.010	98.440	100.000		0.000	Y
7.94 % (7.9 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.01.2017	25.01.2018	35 135 321	%	102.090	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	50'000.00	23.01.2017	26.01.2018	35 135 078	%	134.470	98.790	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	EUR	1'000.00	29.01.2013	29.01.2018	19 539 149	%	97.940	95.290	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	GBP	1'000.00	29.01.2013	29.01.2018	19 539 148	%	99.340	94.490	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	USD	1'000.00	29.01.2013	29.01.2018	19 539 147	%	99.310	95.760	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	29.01.2014	29.01.2018	22 226 749	%	101.100	94.700	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	29.01.2015	29.01.2018	25 823 145	%	87.660	97.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 23.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.964%	USD	1'000.00	28.01.2016	29.01.2018	29 348 001		-	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 23.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.952%	USD	1'000.00	28.01.2016	29.01.2018	29 348 002		-	98.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on S&P GSCI Crd OilER	EUR	1'000.00	29.01.2016	29.01.2018	29 348 036	%	97.360	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.02.2016	29.01.2018	30 498 006	%	80.930	98.180	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Salesforce.com 27.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.694%	USD	1'000.00	22.07.2016	29.01.2018	32 829 428		-	98.740	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.07.2016	29.01.2018	32 829 499	%	99.990	98.650	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	GBP	50'000.00	25.01.2017	29.01.2018	34 443 799	%	100.300	99.440	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	GBP	50'000.00	25.01.2017	29.01.2018	35 135 151	%	89.990	99.590	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Funds	USD	50'000.00	25.01.2017	29.01.2018	34 443 798	%	118.520	88.900	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.684%	USD	1'000.00	23.01.2017	30.01.2018	35 135 368		-	98.770	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.01.2017	30.01.2018	35 327 582	%	109.070	98.770	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	USD	50'000.00	25.01.2017	30.01.2018	25 932 656	%	117.570	98.990	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
9 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.01.2017	30.01.2018	35 327 660	%	100.100	100.000	100.000	28.02.	1.043	N
										28.03.	1.024	
										27.04.	1.036	
										26.05.	1.014	
										28.06.	1.000	
										27.07.	1.003	
										28.08.	0.99483	
										28.09.	1.011	
										26.10.	1.038	
										29.11.	1.025	
										28.12.	1.019	
Underlying Tracker on Equities	USD	50'000.00	26.01.2017	31.01.2018	35 135 197	%	114.350	98.790	100.000		0.000	Y
6.10 % (6.01 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.01.2017	31.01.2018	35 135 326	%	102.590	100.000	100.000		0.000	Y
10.5 % Reverse Convertible on Abercrombie Ftch-A	USD	1'000.00	31.01.2017	31.01.2018	35 448 049	%	60.420	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on EURO BUND FUTURES	EUR	1'000.00	31.01.2017	31.01.2018	35 448 055	%	98.500	100.000	100.000	30.04.	0.000	Y
										31.07.	0.000	
										31.10.	0.000	
8.5 % Reverse Convertible on Abercrombie Ftch-A	USD	1'000.00	31.01.2017	31.01.2018	35 448 050	%	78.110	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Deutsche Bank N	EUR	1'000.00	01.02.2016	01.02.2018	29 348 040	%	119.990	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on AbbVie 28.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	25.07.2016	01.02.2018	32 829 446		-	98.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Gilead Sciences	USD	1'000.00	25.07.2016	01.02.2018	32 829 447	%	94.660	98.740	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 4.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.674%	AUD	1'000.00	27.01.2017	01.02.2018	35 135 221		-	97.950	100.000		0.000	Y
Protection Participation on USD/CNY	USD	1'000.00	02.02.2015	02.02.2018	25 445 211	%	96.360	93.900	97.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	05.02.2014	05.02.2018	22 226 761	%	97.990	93.410	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.02.2015	05.02.2018	26 674 646	%	102.090	96.830	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	05.02.2016	05.02.2018	30 040 824	%	42.760	98.360	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Kite Pharma Rg	EUR	1'000.00	31.01.2017	05.02.2018	35 327 699	%	103.020	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.01.2017	05.02.2018	35 327 797	%	103.440	98.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.02.2015	06.02.2018	26 674 672	%	1.000	97.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.02.2015	06.02.2018	26 674 596	%	4.330	99.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	50'000.00	02.02.2017	07.02.2018	35 327 601	%	112.890	98.740	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Ralph Lauren-A	USD	1'000.00	07.02.2017	07.02.2018	35 550 823	%	110.090	89.070	90.000		0.000	Y
Protection Participation on Tod's N	EUR	1'000.00	07.02.2017	07.02.2018	35 550 822	%	107.260	90.000	90.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	50'000.00	03.02.2017	08.02.2018	35 327 619	%	112.530	98.740	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	50'000.00	03.02.2017	08.02.2018	35 327 618	%	128.870	98.740	100.000		0.000	Y
8.4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.02.2017	08.02.2018	35 327 847	%	106.140	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Tod's N	CHF	1'000.00	08.02.2017	08.02.2018	35 550 833	%	111.330	90.000	90.000		0.000	Y
6.6 % Reverse Convertible on Ralph Lauren-A	CHF	1'000.00	08.02.2017	08.02.2018	35 327 956	%	106.140	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.932%	EUR	1'000.00	30.01.2015	09.02.2018	26 674 593		-	99.490	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on EURO STOXX 50 Index 7.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	09.08.2016	09.02.2018	33 244 954		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 13.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	06.02.2017	09.02.2018	35 448 025		-	100.000	100.000		0.000	Y
7.06 % (7 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.02.2017	09.02.2018	35 327 676	%	105.990	100.000	100.000		0.000	Y
10.8 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	09.02.2017	09.02.2018	35 327 984	%	55.740	100.000	100.000	07.03.	0.000	N
										06.04.	0.000	
										05.05.	0.000	
										07.06.	0.000	
										06.07.	0.000	
										07.08.	0.000	
										08.09.	0.000	
										05.10.	0.000	
										07.11.	0.000	
										07.12.	0.000	

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
10.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	09.02.2017	09.02.2018	35 327 983		n.v.	100.000	100.000	07.03.	0.000	N
										06.04.	0.000	
										05.05.	0.000	
										08.06.	0.000	
										06.07.	0.000	
										07.08.	0.000	
										08.09.	0.000	
										05.10.	0.000	
										07.11.	0.000	
										07.12.	0.000	
Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	11.02.2013	12.02.2018	20 455 107	%	17.170	95.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.02.2017	13.02.2018	35 327 969	%	104.170	98.750	100.000		0.000	Y
7.49 % Reverse Convertible on Enel N	CHF	1'000.00	13.02.2017	13.02.2018	30 041 259	%	106.130	100.000	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.02.2017	13.02.2018	35 550 862	%	107.230	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.02.2017	13.02.2018	35 550 864	%	106.460	100.000	100.000		0.000	Y
9.25 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.02.2017	13.02.2018	35 550 875	%	49.860	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 10.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	14.11.2016	14.02.2018	34 080 645		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	16.11.2016	14.02.2018	34 443 835	%	120.300	98.780	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	16.11.2016	14.02.2018	34 443 839	%	104.070	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	16.02.2016	15.02.2018	31 185 324	%	32.730	98.480	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	15.08.2016	15.02.2018	33 245 082	%	115.120	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Vodafone Group Rg	USD	1'000.00	15.02.2017	15.02.2018	35 328 016	%	104.250	100.000	100.000		0.000	Y
6.7 % Reverse Convertible on Daimler N	USD	1'000.00	15.02.2017	15.02.2018	35 328 017	%	105.890	100.000	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Engie	USD	1'000.00	15.02.2017	15.02.2018	35 328 013	%	107.200	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.11.2016	16.02.2018	33 851 359	%	105.450	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.02.2015	19.02.2018	26 674 533	%	1.000	99.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 16.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.609%	USD	1'000.00	20.02.2015	20.02.2018	26 674 782		-	96.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 19.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.885%	USD	1'000.00	20.02.2015	20.02.2018	25 823 226		-	96.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.02.2017	22.02.2018	35 447 772	%	92.010	98.780	100.000		0.000	Y
5.7 % Reverse Convertible on Total	EUR	1'000.00	22.02.2017	22.02.2018	35 447 876	%	105.600	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	03.03.2015	23.02.2018	26 674 817	%	59.850	96.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	500'000.00	21.02.2017	23.02.2018	35 328 028	%	91.950	98.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.02.2015	26.02.2018	25 924 339	%	101.880	99.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.08.2016	26.02.2018	33 597 453	%	99.310	100.000	100.000		0.000	Y
ReverseConvertible on Equities	USD	1'000.00	27.02.2015	27.02.2018	26 674 563	%	13.940	96.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.02.2017	27.02.2018	35 447 860	%	55.790	98.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.995%	USD	1'000.00	23.02.2017	27.02.2018	35 447 870		-	98.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.02.2017	27.02.2018	35 447 869	%	55.800	98.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.995%	USD	1'000.00	23.02.2017	27.02.2018	35 447 868		-	98.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.02.2017	27.02.2018	35 447 854	%	100.120	98.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.995%	USD	1'000.00	23.02.2017	27.02.2018	35 447 855		-	98.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.02.2017	27.02.2018	35 447 856	%	100.290	98.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.02.2017	27.02.2018	35 447 857	%	100.140	98.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.995%	USD	1'000.00	23.02.2017	27.02.2018	35 447 859		-	98.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.02.2017	27.02.2018	35 447 861	%	100.600	98.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.995%	USD	1'000.00	23.02.2017	27.02.2018	35 447 862		-	98.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.02.2017	27.02.2018	35 447 863	%	100.420	98.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.995%	USD	1'000.00	23.02.2017	27.02.2018	35 447 864		-	98.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.686%	USD	1'000.00	23.02.2017	27.02.2018	35 447 865		-	98.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.02.2017	27.02.2018	35 447 866	%	99.680	98.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.02.2017	27.02.2018	35 447 867	%	100.310	98.720	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Express-Cert. on Equities 22.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.791%	USD	1'000.00	28.02.2013	28.02.2018	20 455 067		-	95.010	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	28.02.2013	28.02.2018	20 571 565	%	46.660	94.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.11.2016	28.02.2018	34 540 819	%	117.840	98.620	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Tod's N	USD	1'000.00	28.02.2017	28.02.2018	35 551 043	%	106.270	88.840	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on VanEck Junior Gold	USD	1'000.00	01.09.2016	01.03.2018	33 245 086	%	100.240	98.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	01.09.2016	01.03.2018	33 245 127		-	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Apple Rg	USD	1'000.00	01.03.2017	01.03.2018	35 551 053	%	91.360	90.747	92.000		0.000	Y
8.5 % Reverse Convertible on Societe Generale	USD	1'000.00	01.03.2017	01.03.2018	35 447 949	%	107.490	100.000	100.000		0.000	Y
9.1 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.03.2017	01.03.2018	35 447 957	%	107.070	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on EUR 10Y Swap	EUR	1'000.00	01.03.2017	01.03.2018	35 551 023	%	104.810	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	02.03.2015	02.03.2018	26 673 878	%	100.450	96.230	100.000		0.000	Y
7.2 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.03.2017	02.03.2018	35 447 981	%	105.770	100.000	100.000		0.000	Y
9.3 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.03.2017	02.03.2018	35 447 991	%	22.020	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	05.03.2015	05.03.2018	25 924 261	%	117.120	96.600	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Tod's N	GBP	1'000.00	03.03.2017	05.03.2018	35 551 064	%	110.170	91.510	92.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Funds	GBP	1'000.00	20.03.2013	06.03.2018	20 571 478	%	96.220	95.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.03.2015	06.03.2018	27 214 231	%	117.780	96.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	06.12.2016	06.03.2018	34 540 855		-	100.000	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible on Societe Generale	USD	1'000.00	06.03.2017	06.03.2018	35 448 011	%	108.980	100.000	100.000		0.000	Y
13.5 % Reverse Convertible on Herbalife Rg	USD	1'000.00	06.03.2017	06.03.2018	35 448 014	%	112.030	100.000	100.000		0.000	Y
6.5 % Reverse Convertible on Alexion Pharm Rg	USD	1'000.00	06.03.2017	06.03.2018	35 448 015	%	106.010	100.000	100.000		0.000	Y
11.5 % Reverse Convertible on Herbalife Rg	EUR	1'000.00	06.03.2017	06.03.2018	35 448 013	%	110.740	100.000	100.000		0.000	Y
8.5 % Reverse Convertible on Societe Generale	EUR	1'000.00	06.03.2017	06.03.2018	35 448 012	%	107.850	100.000	100.000		0.000	Y
8.5 % Reverse Convertible on EDF	USD	1'000.00	06.03.2017	06.03.2018	35 448 010	%	107.580	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.03.2017	07.03.2018	35 447 990	%	93.870	98.710	100.000		0.000	Y
Express-Cert. on Basket	GBP	1'000.00	15.03.2013	08.03.2018	11 218 068	%	100.440	95.160	100.000		0.000	Y
5.5 % Reverse Convertible on Prudential Rg	GBP	1'000.00	08.03.2017	08.03.2018	35 448 190	%	100.250	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on HSBC Hldg Rg	HKD	10'000.00	07.03.2017	09.03.2018	35 447 935	%	125.970	98.510	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Danone	USD	1'000.00	09.03.2017	09.03.2018	35 551 101	%	94.290	93.720	95.000		0.000	Y
6.25 % Reverse Convertible on Fiat Chrysler Au Rg	USD	1'000.00	09.03.2017	09.03.2018	35 551 099	%	69.040	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Fiat Chrysler Au Rg	EUR	1'000.00	09.03.2017	09.03.2018	35 551 102	%	60.550	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Societe Generale	USD	1'000.00	09.03.2017	09.03.2018	35 551 100	%	105.560	93.720	95.000		0.000	Y
7.4 % Reverse Convertible on US Steel Rg	EUR	1'000.00	09.03.2017	09.03.2018	35 551 103	%	106.640	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 12.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	07.03.2017	12.03.2018	35 551 031		-	100.000	100.000		0.000	Y
7.5 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	13.03.2017	13.03.2018	35 550 477	%	106.360	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.03.2016	14.03.2018	31 524 497	%	87.380	98.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.03.2017	14.03.2018	35 550 430	%	85.620	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.03.2017	14.03.2018	35 550 429	%	87.690	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.03.2015	16.03.2018	26 674 741	%	88.750	96.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.03.2015	16.03.2018	26 673 941	%	98.080	96.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Freeport McMoRan	USD	1'000.00	16.03.2016	16.03.2018	31 524 515	%	98.250	98.170	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	16.12.2016	16.03.2018	34 765 818	%	117.860	98.610	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.03.2017	16.03.2018	35 448 127	%	125.410	98.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.03.2017	16.03.2018	35 550 493	%	94.080	98.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.03.2017	16.03.2018	35 550 492	%	80.840	98.660	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.03.2017	16.03.2018	35 550 593	%	106.690	100.000	100.000		0.000	Y
6.85 % Reverse Convertible on Celgene Corp Rg	CHF	1'000.00	16.03.2017	16.03.2018	30 041 263	%	96.070	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.03.2017	16.03.2018	35 914 165	%	80.100	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.03.2015	19.03.2018	26 673 954	%	46.470	96.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.03.2015	19.03.2018	26 673 955	%	96.170	96.170	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Barrick Gold 16.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.05%	USD	1'000.00	19.09.2016	19.03.2018	33 597 653		-	98.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 16.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.018%	USD	1'000.00	20.09.2016	20.03.2018	33 597 643		-	98.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 20.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.412%	USD	1'000.00	09.02.2017	20.03.2018	35 327 921		-	98.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.429%	USD	1'000.00	06.09.2016	21.03.2018	33 597 728		-	98.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.083%	USD	1'000.00	14.09.2016	21.03.2018	33 597 836		-	98.560	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	500'000.00	17.03.2017	21.03.2018	35 550 438	%	106.670	98.510	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on USD 10Y Swap	USD	1'000.00	21.03.2017	21.03.2018	35 914 184	%	102.020	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Horizon Pharma 24.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	06.10.2016	22.03.2018	34 080 742		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	50'000.00	17.03.2017	22.03.2018	35 550 452	%	97.600	98.630	100.000		0.000	Y
6.5 % Reverse Convertible on Societe Generale	USD	1'000.00	22.03.2017	22.03.2018	35 550 692	%	105.330	100.000	100.000		0.000	Y
Barrier Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	23.06.2014	23.03.2018	24 564 738	%	9.150	98.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.03.2015	23.03.2018	26 673 942	%	100.170	96.060	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Deutsche Bank N	USD	1'000.00	23.09.2016	23.03.2018	33 597 749	%	126.760	98.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.12.2016	23.03.2018	34 540 763	%	103.790	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	28.12.2016	23.03.2018	35 135 251	%	102.930	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.03.2017	23.03.2018	35 550 623	%	80.580	98.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.03.2017	23.03.2018	35 550 620	%	58.980	98.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.03.2017	23.03.2018	35 550 622	%	86.090	98.620	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on JC Penney Rg	USD	1'000.00	23.03.2017	23.03.2018	35 914 212	%	107.070	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.09.2014	26.03.2018	25 444 934	%	100.940	94.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.03.2015	26.03.2018	27 339 365	%	101.120	96.540	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Danone	USD	1'000.00	24.03.2017	26.03.2018	35 914 292	%	89.280	88.750	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 23.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.003%	USD	1'000.00	20.09.2016	27.03.2018	33 851 162		-	98.500	100.000		0.000	Y
6.7 % Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	27.03.2017	27.03.2018	35 914 299	%	104.750	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.03.2016	28.03.2018	30 041 139	%	75.150	98.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.949%	USD	1'000.00	28.03.2016	28.03.2018	31 185 340		-	98.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	28.09.2016	28.03.2018	33 597 852		-	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	GBP	1'000.00	28.09.2016	28.03.2018	33 851 350	%	103.000	89.500	90.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.12.2016	28.03.2018	34 902 260	%	125.930	98.420	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.12.2016	28.03.2018	34 902 259	%	117.880	98.420	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	28.12.2016	28.03.2018	34 902 258	%	117.860	98.420	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	29.12.2016	29.03.2018	34 902 280	%	117.430	98.410	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	29.12.2016	29.03.2018	34 902 283	%	113.810	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	29.12.2016	29.03.2018	34 902 013		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	29.12.2016	29.03.2018	34 902 279	%	111.080	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	500'000.00	27.03.2017	29.03.2018	35 550 627	%	119.210	98.520	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	50'000.00	27.03.2017	29.03.2018	35 550 628	%	123.410	100.000	100.000		0.000	Y
9.25 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.03.2017	30.03.2018	35 914 243	%	102.650	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 29.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.30%	USD	1'000.00	08.10.2014	02.04.2018	24 205 269		-	95.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 28.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.318%	USD	1'000.00	02.04.2015	02.04.2018	26 674 031		-	96.740	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.04.2015	02.04.2018	26 674 029	%	94.740	96.770	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 30.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.347%	USD	1'000.00	02.04.2015	02.04.2018	26 673 988		-	96.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	02.04.2015	02.04.2018	27 339 439	%	112.390	96.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.03.2017	02.04.2018	35 550 791	%	98.760	98.620	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	50'000.00	28.03.2017	02.04.2018	35 550 656	%	104.900	98.590	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.03.2017	02.04.2018	35 550 790	%	101.170	98.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.03.2017	02.04.2018	35 550 789	%	97.330	98.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.03.2017	02.04.2018	35 550 786	%	100.940	98.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.03.2017	02.04.2018	35 550 788	%	97.370	98.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.03.2017	02.04.2018	35 550 787	%	79.090	98.620	100.000		0.000	Y
7.5 % Reverse Convertible on Vertex Pharmaceu Rg	USD	1'000.00	30.03.2017	02.04.2018	36 170 997	%	40.560	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	31.03.2017	02.04.2018	36 171 010	%	49.310	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.03.2017	02.04.2018	36 171 009	%	47.340	100.000	100.000		0.000	Y
Capital Protection with Reference Bond on Basket	USD	1'000.00	22.02.2013	03.04.2018	20 571 493	%	128.210	83.470	95.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities 2.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.411%	GBP	1'000.00	15.04.2013	03.04.2018	20 571 773		-	95.130	100.000		0.000	Y
Contingent Capital Protected Certificate on SHS BSKT with Reference Bond	EUR	1'000.00	22.04.2013	03.04.2018	20 571 644	%	113.230	88.420	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Basket	EUR	1'000.00	26.01.2015	03.04.2018	26 670 382	%	104.930	91.110	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.961%	EUR	1'000.00	01.04.2015	03.04.2018	26 673 968		-	99.580	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.03.2017	03.04.2018	36 171 008	%	105.280	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	04.04.2013	04.04.2018	20 571 775	%	50.320	95.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.03.2016	04.04.2018	31 524 555	%	50.000	98.190	100.000		0.000	Y
12.5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.04.2017	04.04.2018	35 914 297	%	110.180	100.000	100.000		0.000	Y
6.5 % Reverse Convertible on Deutsche Bank N	USD	1'000.00	04.04.2017	04.04.2018	36 171 049	%	106.050	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on JC Penney Rg	USD	1'000.00	04.04.2017	04.04.2018	36 171 050	%	81.800	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	05.10.2016	05.04.2018	33 851 111		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 5.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.332%	USD	1'000.00	30.03.2017	05.04.2018	35 914 262		-	98.630	100.000		0.000	Y
7.25 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.04.2017	05.04.2018	36 171 055	%	46.470	100.000	100.000		0.000	Y
15.1 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	05.07.2017	05.04.2018	37 153 720	%	101.570	100.000	100.000	05.10.	0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.04.2016	06.04.2018	31 524 529	%	101.790	98.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.149%	GBP	1'000.00	06.10.2016	06.04.2018	33 851 121		-	99.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.321%	USD	1'000.00	13.03.2017	06.04.2018	35 550 448		-	98.540	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	13.03.2017	06.04.2018	35 550 454		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	13.03.2017	06.04.2018	35 550 453		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.362%	USD	1'000.00	03.04.2017	06.04.2018	35 914 342		-	98.650	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Daimler N	EUR	50'000.00	04.04.2017	06.04.2018	35 550 762	%	109.820	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.10.2014	09.04.2018	24 205 311	%	90.010	95.180	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	09.04.2015	09.04.2018	26 674 054	%	101.180	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.477%	USD	1'000.00	09.04.2015	09.04.2018	24 204 450		-	96.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.04.2017	09.04.2018	35 914 374	%	98.770	98.620	100.000		0.000	Y
Barrier Reverse Convertible on basket	EUR	1'000.00	10.04.2014	10.04.2018	23 581 279	%	0.050	97.430	100.000	13.01. 13.04. 13.07. 13.10.	0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	10.04.2015	10.04.2018	27 339 493	%	99.980	96.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 3.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.464%	USD	1'000.00	10.04.2015	10.04.2018	27 339 546		-	96.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Murphy Oil	USD	1'000.00	10.01.2017	10.04.2018	34 902 246	%	101.000	98.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Commodities 11.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.365%	USD	1'000.00	05.04.2017	10.04.2018	36 170 760		-	98.640	100.000		0.000	Y
6.55 % Reverse Convertible on LendingClub Rg	EUR	1'000.00	10.04.2017	10.04.2018	36 170 811	%	104.870	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.10.2016	11.04.2018	34 080 755	%	118.720	98.530	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Apple	USD	1'000.00	12.10.2016	12.04.2018	34 080 764	%	108.960	98.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.04.2015	13.04.2018	26 674 078	%	101.200	99.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on First Solar	USD	1'000.00	13.04.2016	13.04.2018	31 185 458	%	127.950	98.340	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Funds	GBP	1'000.00	16.04.2014	16.04.2018	23 581 256	%	100.900	93.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.04.2015	16.04.2018	27 339 562	%	47.350	99.700	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.04.2015	16.04.2018	27 339 576	%	98.890	96.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	5'084'000.00	12.04.2017	16.04.2018	36 171 028	%	113.590	98.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.10.2014	17.04.2018	25 445 180	%	108.100	95.580	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	10'000.00	12.04.2017	17.04.2018	35 914 378	%	40.980	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	500'000.00	13.04.2017	17.04.2018	36 170 764	%	122.470	98.520	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	500'000.00	13.04.2017	17.04.2018	36 171 032	%	113.970	98.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.04.2016	18.04.2018	31 524 604	%	57.110	98.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Clovis Oncology 16.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	02.11.2016	18.04.2018	34 080 918		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Exact Sciences 16.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	02.11.2016	18.04.2018	34 080 919		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	50'000.00	13.04.2017	18.04.2018	36 170 777	%	65.620	98.630	100.000		0.000	Y
6.5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.04.2017	18.04.2018	36 171 230	%	47.910	100.000	100.000		0.000	Y
9.5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.04.2017	19.04.2018	36 171 263	%	38.440	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.04.2015	20.04.2018	26 674 125	%	83.570	96.770	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.04.2015	23.04.2018	26 674 130	%	67.060	96.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	23.04.2015	23.04.2018	27 339 319	%	27.180	96.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.04.2015	23.04.2018	26 674 127	%	67.260	96.770	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.304%	USD	1'000.00	23.04.2015	23.04.2018	27 339 572		-	96.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 20.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.965%	EUR	1'000.00	23.04.2015	23.04.2018	26 674 133		-	99.730	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	24.04.2015	23.04.2018	27 339 704	%	98.850	99.730	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 20.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.03.2017	23.04.2018	35 550 752		-	100.000	100.000		0.000	Y
6.05 % (6 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.04.2017	23.04.2018	36 171 102	%	100.570	100.000	100.000		0.000	Y
6.05 % (6 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.04.2017	23.04.2018	36 171 101	%	39.030	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.04.2015	24.04.2018	26 674 196	%	97.400	97.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.04.2015	24.04.2018	26 674 116	%	106.120	99.700	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 20.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.887%	USD	1'000.00	24.10.2016	24.04.2018	33 851 428		-	98.520	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	24.10.2016	24.04.2018	33 851 413	%	69.780	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Alibaba Grp Sp ADS 20.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.665%	USD	1'000.00	24.01.2017	24.04.2018	35 135 371		-	98.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 23.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.912%	USD	1'000.00	01.11.2016	25.04.2018	33 851 451		-	98.550	100.000		0.000	Y
9.5 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	25.04.2017	25.04.2018	36 171 307	%	30.050	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 28.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	10'000.00	21.04.2017	26.04.2018	36 170 849		-	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.04.2017	26.04.2018	36 171 312	%	100.050	100.000	100.000		0.000	Y
7.55 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.04.2017	26.04.2018	36 171 313	%	55.980	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on YPF SA Sp ADR-D 25.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.868%	USD	1'000.00	27.10.2016	27.04.2018	34 080 487		-	98.500	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	AUD	1'000.00	27.01.2017	27.04.2018	35 448 047	%	101.190	97.410	100.000		0.000	Y
11.1 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.04.2017	27.04.2018	36 171 318	%	41.280	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Funds	USD	1'000.00	03.05.2013	30.04.2018	20 571 853	%	97.720	95.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Mkt Vctr Rus ETFTr 27.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.531%	USD	1'000.00	30.04.2015	30.04.2018	27 991 951		-	96.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.04.2015	30.04.2018	27 339 620	%	90.590	96.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.04.2015	30.04.2018	26 674 158	%	106.460	99.730	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Platin 1 Uz 999	USD	1'000.00	30.04.2015	30.04.2018	27 991 950	%	99.630	96.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.04.2015	30.04.2018	26 674 160	%	110.410	99.730	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.04.2015	30.04.2018	26 674 224	%	92.510	96.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.04.2015	30.04.2018	26 674 228	%	99.520	96.890	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	30.04.2015	30.04.2018	27 991 952	%	100.740	96.800	100.000		0.000	Y
8.07 % (8 % p.a.) Reverse Convertible on JC Penney Rg	USD	1'000.00	27.04.2017	30.04.2018	36 171 317	%	106.640	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.05.2015	01.05.2018	27 339 731	%	98.100	96.800	100.000		0.000	Y
6.08 % (8.1 % p.a.) Reverse Convertible on Anglo American Rg	GBP	1'000.00	01.08.2017	01.05.2018	37 420 854	%	105.170	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ABB N	CHF	19.93	01.11.2016	02.05.2018	34 080 924	CHF	21.710	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	04.11.2016	02.05.2018	34 080 501		-	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on EURO STOXX 50 Index 1.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	03.11.2016	03.05.2018	34 080 899		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	03.11.2016	03.05.2018	34 080 601		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.32%	USD	1'000.00	30.03.2017	03.05.2018	35 914 258		-	98.500	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on IBEX 35	USD	1'000.00	04.05.2015	04.05.2018	26 674 202	%	98.590	96.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.05.2017	04.05.2018	36 170 964	%	91.130	98.640	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Funds	USD	1'000.00	03.06.2013	07.05.2018	20 571 610	%	96.700	96.010	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Banco Santander	EUR	1'000.00	07.05.2014	07.05.2018	24 205 540	%	98.260	96.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	CAD	1'000.00	05.05.2015	07.05.2018	27 991 978	%	103.790	96.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.05.2015	07.05.2018	26 674 290	%	9.770	96.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 2.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.416%	USD	1'000.00	07.05.2015	07.05.2018	26 674 296		-	96.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.05.2015	07.05.2018	26 674 269	%	23.970	96.770	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.05.2015	07.05.2018	26 674 289	%	1.000	96.740	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	08.05.2015	07.05.2018	27 992 005	%	107.410	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	06.11.2015	07.05.2018	29 348 169	%	113.700	99.630	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	08.05.2014	08.05.2018	23 092 998	%	95.170	93.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.05.2015	08.05.2018	27 339 743	%	77.940	99.640	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.05.2016	08.05.2018	32 339 392	%	110.830	98.180	100.000		0.000	Y
4.89 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.05.2017	08.05.2018	36 171 162	%	100.520	100.000	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.05.2017	08.05.2018	36 171 161	%	102.220	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Anglo American 5.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.253%	GBP	1'000.00	09.05.2016	09.05.2018	31 185 564		-	98.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 10.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.994%	USD	1'000.00	04.11.2016	09.05.2018	34 080 966		-	98.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	09.11.2016	09.05.2018	34 080 667	%	96.030	98.500	100.000		0.000	Y
7.25 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.05.2017	09.05.2018	36 171 492	%	53.850	100.000	100.000		0.000	Y
6.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	09.05.2017	09.05.2018	36 171 491	%	98.770	100.000	100.000		0.000	Y
7.81 % Reverse Convertible on Equities 7.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	09.08.2017	09.05.2018	37 421 079		n.v.	100.000	100.000	08.09. 05.10. 07.11.	1.256 1.296 1.323	N
7.3 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.08.2017	09.05.2018	37 421 078	%	100.800	100.000	100.000	08.09. 05.10. 07.11. 07.12.	1.255 1.294 1.322 1.315	N
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	17.05.2013	10.05.2018	21 229 521	%	6.440	95.780	100.000		0.000	Y
7.4 % Reverse Convertible on Deutsche Bank N	USD	1'000.00	10.05.2017	10.05.2018	36 171 168	%	100.320	100.000	100.000		0.000	Y
7.75 % Reverse Convertible on Tesla Rg	USD	1'000.00	10.05.2017	10.05.2018	36 171 169	%	101.090	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Commodities	USD	10'000.00	08.05.2017	11.05.2018	36 170 945	%	96.910	98.630	100.000		0.000	Y
12 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.05.2017	11.05.2018	36 171 535	%	76.470	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.05.2015	14.05.2018	26 674 348	%	102.190	96.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	14.05.2015	14.05.2018	26 674 334	%	90.490	96.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 9.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.43%	USD	1'000.00	14.05.2015	14.05.2018	26 674 325		-	96.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Fiat Chrysler Auto 14.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	25.11.2016	14.05.2018	34 443 946		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Twitter 14.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	25.11.2016	14.05.2018	34 443 949		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Bombard -B- Sub Vtg 14.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	28.11.2016	14.05.2018	34 443 950		-	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on UniCredit 14.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	28.11.2016	14.05.2018	34 443 974		-	100.000	100.000	14.02.	0.000	Y
Reverse Convertible on UniCredit 14.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	28.11.2016	14.05.2018	34 443 945		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on E.ON N 14.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	28.11.2016	14.05.2018	34 443 947		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	13.02.2017	14.05.2018	35 550 881	%	100.580	98.410	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Kakao	CHF	1'000.00	12.05.2017	14.05.2018	36 171 544	%	94.410	95.000	95.000		0.000	Y
Protection Participation on Kakao	AUD	1'000.00	12.05.2017	14.05.2018	36 171 545	%	93.630	93.360	95.000		0.000	Y
Protection Participation on Kakao	CAD	1'000.00	12.05.2017	14.05.2018	36 171 546	%	93.680	94.120	95.000		0.000	Y
Protection Participation on Kakao	GBP	1'000.00	12.05.2017	14.05.2018	36 171 547	%	93.990	94.354	95.000		0.000	Y
Protection Participation on Kakao	EUR	1'000.00	12.05.2017	14.05.2018	36 171 548	%	94.290	95.000	95.000		0.000	Y
Protection Participation on Kakao	USD	1'000.00	12.05.2017	14.05.2018	36 171 549	%	93.570	93.688	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	15.05.2015	15.05.2018	27 339 735	%	76.050	96.430	100.000		0.000	Y
5.75 % Reverse Convertible on Air France - KLM	USD	1'000.00	15.05.2017	15.05.2018	36 171 348	%	100.550	100.000	100.000		0.000	Y
6.25 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.05.2017	15.05.2018	36 171 223	%	99.810	100.000	100.000		0.000	Y
7.5 % Reverse Convertible on Abercrombie Ftch-A	EUR	1'000.00	15.05.2017	15.05.2018	36 171 227	%	102.640	100.000	100.000		0.000	Y
7.13 % (9.5 % p.a.) Reverse Convertible on Easyjet Rg	GBP	1'000.00	15.08.2017	15.05.2018	37 643 848	%	105.660	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	USD	1'000.00	30.05.2013	16.05.2018	11 218 158	%	96.140	95.650	100.000		0.000	Y
8.79 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.05.2017	16.05.2018	36 171 370	%	103.000	100.000	100.000		0.000	Y
10.5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.05.2017	16.05.2018	36 171 565	%	41.960	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 11.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.527% 11.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	17.11.2014	17.05.2018	24 205 503		-	95.350	100.000	11.05.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 11.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.453%	USD	1'000.00	21.05.2015	17.05.2018	27 992 798		-	96.670	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	17.11.2016	17.05.2018	34 540 765	%	106.250	98.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	17.11.2016	17.05.2018	34 443 638		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 15.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	17.02.2017	17.05.2018	35 447 778		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Swedbank -A-	SEK	1'000.00	18.11.2014	18.05.2018	25 445 044	%	108.690	98.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.05.2016	18.05.2018	31 524 464	%	103.960	98.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 16.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.519%	USD	1'000.00	18.05.2016	18.05.2018	31 185 620		-	98.300	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.05.2017	18.05.2018	36 171 605	%	99.480	100.000	100.000		0.000	Y
4.35 % (7.5 % p.a.) Reverse Convertible on Qualcomm Rg	EUR	1'000.00	19.10.2017	18.05.2018	38 485 567	%	103.100	100.000	100.000		0.000	Y
3.77 % (6.5 % p.a.) Reverse Convertible on Nokia Rg	EUR	1'000.00	19.10.2017	18.05.2018	38 485 566	%	84.520	100.000	100.000		0.000	Y
4.35 % (7.5 % p.a.) Reverse Convertible on ArcelorMittal Rg	EUR	1'000.00	19.10.2017	18.05.2018	38 485 565	%	102.980	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.05.2015	21.05.2018	27 992 777	%	16.590	96.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.05.2015	21.05.2018	26 674 416	%	17.820	96.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.05.2015	21.05.2018	26 674 419	%	28.360	96.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.05.2015	21.05.2018	27 992 000	%	27.680	99.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.05.2015	21.05.2018	26 674 417	%	23.730	96.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.05.2015	21.05.2018	27 991 999	%	129.400	99.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	01.06.2015	21.05.2018	27 339 659	%	63.210	99.410	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 18.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.476%	USD	1'000.00	22.05.2015	22.05.2018	26 674 449		-	96.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	22.05.2015	22.05.2018	26 674 354	%	99.350	99.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 20.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	17.05.2017	22.05.2018	36 171 180		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 20.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	17.05.2017	22.05.2018	36 171 179		-	100.000	100.000		0.000	Y
22 % Reverse Convertible on Sears Holdings Rg	USD	1'000.00	22.05.2017	22.05.2018	36 171 442	%	71.310	100.000	100.000		0.000	Y
6.5 % Reverse Convertible on Avis Budget Grou Rg	GBP	1'000.00	22.05.2017	22.05.2018	36 171 721	%	40.090	100.000	100.000		0.000	Y
9 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.05.2017	22.05.2018	36 171 719	%	48.920	100.000	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Sprint-1	USD	1'000.00	22.05.2017	22.05.2018	36 171 720	%	102.440	100.000	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	22.05.2017	22.05.2018	36 171 722	%	35.540	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Basket 19.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.418%	USD	1'000.00	18.05.2015	23.05.2018	26 674 314		-	96.550	100.000	19.05.	0.000	Y
11 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.05.2017	23.05.2018	36 171 611	%	108.520	100.000	100.000		0.000	Y
7.1 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.05.2017	24.05.2018	36 171 742	%	103.030	100.000	100.000		0.000	Y
8.5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.05.2017	24.05.2018	36 171 741	%	38.850	100.000	100.000		0.000	Y
Barrier Reverse Convertible on REPSOL	EUR	1'000.00	27.05.2014	25.05.2018	24 205 724	%	84.440	97.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	25.05.2015	25.05.2018	26 674 379	%	98.970	99.490	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	100.00	25.05.2015	25.05.2018	27 992 812	%	95.270	99.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BBVA	EUR	1'000.00	28.05.2015	28.05.2018	26 674 464	%	91.480	99.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 23.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.871%	EUR	1'000.00	28.05.2015	28.05.2018	27 992 821		-	99.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.05.2016	28.05.2018	32 339 454	%	26.090	97.990	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	29.05.2014	29.05.2018	24 205 749	%	102.960	95.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.05.2015	29.05.2018	26 674 485	%	101.050	96.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.05.2015	29.05.2018	27 339 657	%	14.220	96.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.05.2015	29.05.2018	27 214 206	%	77.540	96.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.392%	USD	1'000.00	29.05.2015	29.05.2018	27 992 822		-	96.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.05.2015	29.05.2018	27 214 205	%	119.620	96.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	03.06.2015	29.05.2018	27 339 660	%	50.410	96.410	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.628%	USD	1'000.00	29.11.2016	29.05.2018	34 443 881		-	98.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.628%	USD	1'000.00	29.11.2016	29.05.2018	34 443 880		-	98.330	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	29.11.2016	29.05.2018	34 540 830	%	130.910	98.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	CAD	1'000.00	25.01.2017	29.05.2018	35 327 827	%	102.620	98.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.03.2017	29.05.2018	35 551 057	%	74.890	100.000	100.000		0.000	Y
9.08 % (9 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.05.2017	29.05.2018	36 786 278	%	27.310	100.000	100.000		0.000	Y
7.06 % (7 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	26.05.2017	29.05.2018	36 786 277	%	44.390	100.000	100.000		0.000	Y
8.57 % (8.5 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	26.05.2017	29.05.2018	36 786 276	%	26.750	100.000	100.000		0.000	Y
6.53 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.05.2017	29.05.2018	36 171 618	%	101.900	100.000	100.000		0.000	Y
5.8 % Reverse Convertible on Enel N	CHF	1'000.00	29.05.2017	29.05.2018	36 786 287	%	103.950	100.000	100.000		0.000	Y
4.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.05.2017	29.05.2018	36 171 756	%	103.660	100.000	100.000		0.000	Y
7.3 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.05.2017	30.05.2018	36 786 280	%	103.770	100.000	100.000		0.000	Y
5.9 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.05.2017	30.05.2018	36 786 279	%	102.810	100.000	100.000		0.000	Y
10.75 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.05.2017	30.05.2018	36 786 163	%	104.280	100.000	100.000		0.000	Y
5.9 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.05.2017	30.05.2018	36 786 282	%	102.300	100.000	100.000		0.000	Y
7.25 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.05.2017	30.05.2018	36 786 292	%	84.770	100.000	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Sprint-1	USD	1'000.00	30.05.2017	30.05.2018	36 786 291	%	105.870	100.000	100.000		0.000	Y
10.7 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.05.2017	30.05.2018	36 786 281	%	106.260	100.000	100.000		0.000	Y
9.5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.05.2017	30.05.2018	36 786 293	%	49.480	100.000	100.000		0.000	Y
4.15 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	31.05.2017	31.05.2018	36 786 327	%	101.330	100.000	100.000		0.000	Y
8.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	31.05.2017	31.05.2018	36 786 328	%	103.810	100.000	100.000		0.000	Y
7 % (12 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.11.2017	31.05.2018	38 485 946	%	98.890	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.46%	USD	1'000.00	01.06.2015	01.06.2018	26 674 439		-	96.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	01.06.2015	01.06.2018	27 992 857	%	98.480	96.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.06.2016	01.06.2018	31 185 697	%	61.270	97.930	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	04.06.2013	04.06.2018	21 385 588	%	60.430	94.960	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities 4.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.928%	EUR	1'000.00	04.06.2014	04.06.2018	23 581 354		-	97.710	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	10.06.2014	04.06.2018	24 205 757	%	119.790	97.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	CAD	1'000.00	02.06.2015	04.06.2018	27 992 927	%	104.810	96.540	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 31.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.879%	EUR	1'000.00	04.06.2015	04.06.2018	27 992 086		-	99.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.06.2015	04.06.2018	27 339 683	%	56.230	96.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.884%	USD	1'000.00	04.06.2015	04.06.2018	26 674 517		-	96.430	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 2.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.053%	USD	1'000.00	04.06.2015	04.06.2018	27 992 871		-	96.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 31.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.198%	GBP	1'000.00	04.06.2015	04.06.2018	26 674 516		-	96.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.05.2016	04.06.2018	32 339 402	%	100.700	98.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	03.03.2017	04.06.2018	35 551 072		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.142%	USD	1'000.00	31.05.2017	04.06.2018	36 786 156		-	98.640	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on UBS Group N	USD	1'000.00	17.06.2015	05.06.2018	28 370 824	%	83.820	96.100	100.000		0.000	Y
9.5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.06.2017	05.06.2018	36 171 701	%	105.870	100.000	100.000		0.000	Y
8.75 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.06.2017	05.06.2018	36 171 702	%	106.830	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.05.2016	06.06.2018	32 339 403	%	104.660	98.210	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	09.03.2017	06.06.2018	35 447 978	%	101.420	99.440	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	07.06.2013	07.06.2018	21 385 597	%	94.860	95.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	14.12.2016	07.06.2018	34 540 886		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 9.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	02.06.2017	07.06.2018	36 171 660		-	100.000	100.000		0.000	Y
Outperformance Bonus Certificates on Basket	USD	1'000.00	08.06.2015	08.06.2018	28 370 792	%	104.360	96.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.06.2016	08.06.2018	31 185 731	%	103.690	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.06.2016	08.06.2018	32 339 489	%	105.490	98.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	08.03.2017	08.06.2018	35 551 086	%	100.510	98.240	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Indices	USD	1'000.00	08.06.2017	08.06.2018	36 786 337	%	99.680	90.770	92.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.05.2015	11.06.2018	27 992 797	%	24.780	96.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.06.2015	11.06.2018	27 992 146	%	98.100	99.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	11.06.2015	11.06.2018	27 992 136	%	95.500	96.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	12.06.2015	11.06.2018	27 992 894	%	99.220	96.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Cisco Systems	USD	1'000.00	09.06.2016	11.06.2018	32 339 504	%	100.520	97.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on UBS Group N	CHF	1'000.00	09.06.2016	11.06.2018	32 339 495	%	97.290	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Commerzbank	EUR	1'000.00	09.06.2016	11.06.2018	32 339 496	%	100.620	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Vivendi	EUR	1'000.00	09.06.2016	11.06.2018	32 339 499	%	96.710	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Nokia	EUR	1'000.00	09.06.2016	11.06.2018	32 339 498	%	43.430	99.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BP	GBP	1'000.00	09.06.2016	11.06.2018	32 339 500	%	100.880	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Nokia Sp ADR	USD	1'000.00	09.06.2016	11.06.2018	32 339 505	%	81.900	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Credit Agricole	EUR	1'000.00	09.06.2016	11.06.2018	32 339 497	%	100.730	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Tesco PLC	GBP	1'000.00	09.06.2016	11.06.2018	32 339 501	%	97.560	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Axa	EUR	1'000.00	09.06.2016	11.06.2018	32 339 503	%	98.420	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on HP	USD	1'000.00	09.06.2016	11.06.2018	32 339 502	%	95.620	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	JPY	100'000.00	09.03.2017	11.06.2018	35 914 120	%	100.560	99.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.891%	EUR	100.00	12.06.2015	12.06.2018	27 991 992		-	99.280	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on MSCI Italy	EUR	1'000.00	12.12.2016	12.06.2018	34 765 652	%	115.080	100.000	100.000		0.000	Y
7.17 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.06.2017	12.06.2018	36 786 361	%	104.420	100.000	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.06.2017	12.06.2018	30 041 285	%	106.490	100.000	100.000		0.000	Y
4.5 % (6 % p.a.) Reverse Convertible on Airbus Br	GBP	1'000.00	12.09.2017	12.06.2018	37 749 961	%	102.330	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Funds	EUR	1'000.00	13.06.2013	13.06.2018	11 218 201	%	94.470	95.010	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	GBP	1'000.00	13.06.2013	13.06.2018	21 385 590	%	100.800	94.210	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	13.06.2014	13.06.2018	23 581 383	%	90.220	94.810	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	13.06.2014	13.06.2018	23 581 382	%	90.550	94.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 11.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.059%	USD	1'000.00	13.12.2016	13.06.2018	34 765 663		-	98.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.882%	USD	1'000.00	13.03.2017	13.06.2018	35 550 424		-	98.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	13.03.2017	13.06.2018	35 550 935		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 11.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.353%	USD	1'000.00	06.06.2017	13.06.2018	36 786 206		-	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.06.2017	13.06.2018	36 786 209	%	78.280	98.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.06.2017	13.06.2018	36 786 208	%	78.420	98.650	100.000		0.000	Y
7.25 % Reverse Convertible on EDF	USD	1'000.00	13.06.2017	13.06.2018	36 786 394	%	100.820	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
11.5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.06.2017	13.06.2018	36 786 391	%	102.590	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Deutsche Bank N	CHF	1'000.00	13.06.2017	13.06.2018	36 786 388	%	99.230	100.000	100.000		0.000	Y
9.25 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.06.2017	13.06.2018	36 786 522	%	27.470	100.000	100.000		0.000	Y
11 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.06.2017	13.06.2018	36 786 392	%	102.830	100.000	100.000		0.000	Y
9.32 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.06.2017	13.06.2018	36 786 390	%	106.120	100.000	100.000		0.000	Y
7.5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.06.2017	13.06.2018	36 786 523	%	29.750	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.06.2016	14.06.2018	31 185 724	%	101.430	97.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.06.2016	14.06.2018	31 185 723	%	92.730	97.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 10.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.435%	USD	1'000.00	14.12.2016	14.06.2018	34 765 543		-	98.210	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.06.2017	14.06.2018	36 786 376	%	71.610	98.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.06.2017	14.06.2018	36 786 375	%	97.020	98.660	100.000		0.000	Y
10.5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.06.2017	14.06.2018	36 786 389	%	102.250	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.06.2017	14.06.2018	36 786 406	%	103.900	100.000	100.000		0.000	Y
12 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.06.2017	14.06.2018	36 786 407	%	102.840	100.000	100.000		0.000	Y
Capital Protection Note on Equities	CHF	1'000.00	15.06.2011	15.06.2018	12 618 131	%	99.900	88.080	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.06.2015	15.06.2018	27 992 102	%	104.450	99.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	15.06.2015	15.06.2018	27 339 662	%	81.180	96.110	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTXBnk EUR P 13.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	16.12.2016	15.06.2018	34 765 811		-	100.000	100.000		0.000	Y
7.5 % Reverse Convertible on Deutsche Bank N	USD	1'000.00	15.06.2017	15.06.2018	36 786 393	%	99.660	100.000	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible on Air France - KLM	USD	1'000.00	15.06.2017	15.06.2018	36 786 433	%	106.820	100.000	100.000		0.000	Y
8.6 % Reverse Convertible on Air France - KLM	EUR	1'000.00	15.06.2017	15.06.2018	36 786 434	%	106.430	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Crude Oil	USD	1'000.00	15.09.2017	15.06.2018	38 126 850	%	93.570	93.890	95.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	18.06.2014	18.06.2018	23 581 391	%	82.850	94.480	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities 15.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.234%	USD	1'000.00	18.06.2014	18.06.2018	23 581 392		-	94.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 15.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.801%	EUR	1'000.00	18.06.2015	18.06.2018	27 992 180		-	99.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.06.2015	18.06.2018	28 370 794	%	90.750	99.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.03.2017	18.06.2018	35 550 467	%	97.910	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Deutsche Bank N 16.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.355%	USD	1'000.00	19.12.2016	19.06.2018	34 902 070		-	98.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.06.2017	19.06.2018	36 786 428	%	98.580	98.640	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Micron Technology	USD	1'000.00	19.12.2016	20.06.2018	34 540 851	%	128.160	98.150	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on DAX	EUR	1'000.00	20.12.2016	20.06.2018	34 902 087	%	110.440	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	20.03.2017	20.06.2018	35 914 196	%	100.050	98.180	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 20.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.09%	USD	1'000.00	15.06.2017	20.06.2018	36 786 537		-	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.06.2017	20.06.2018	36 786 536	%	97.030	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.06.2017	20.06.2018	36 786 535	%	98.660	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.06.2017	20.06.2018	36 786 538	%	98.750	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.06.2017	20.06.2018	36 786 534	%	98.920	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 20.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.356%	USD	1'000.00	15.06.2017	20.06.2018	36 786 541		-	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.06.2017	20.06.2018	36 786 540	%	97.940	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 20.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.356% 20.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	15.06.2017	20.06.2018	36 786 539		-	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.06.2017	20.06.2018	36 786 533	%	97.500	98.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Veolia Environn.	EUR	1'000.00	28.06.2016	21.06.2018	32 339 618	%	108.190	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.235%	USD	1'000.00	21.12.2016	21.06.2018	34 765 770		-	98.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.12.2016	21.06.2018	34 765 771	%	72.130	98.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BBVA 17.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.335%	USD	1'000.00	21.12.2016	21.06.2018	34 765 728		-	98.140	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Banco Santander 17.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.335%	USD	1'000.00	21.12.2016	21.06.2018	34 765 736		-	98.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	21.03.2017	21.06.2018	35 914 200	%	100.130	98.230	100.000		0.000	Y
10.75 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.06.2017	21.06.2018	36 786 609	%	103.160	100.000	100.000		0.000	Y
10.5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.06.2017	21.06.2018	36 786 612	%	101.360	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 20.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.271%	USD	1'000.00	22.06.2015	22.06.2018	27 992 222		-	96.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Vale Sp ADR 20.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.162%	USD	1'000.00	22.12.2016	22.06.2018	34 765 838		-	98.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Petroleo Br Sp ADR 20.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.162%	USD	1'000.00	22.12.2016	22.06.2018	34 765 837		-	98.010	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	50'000.00	19.06.2017	22.06.2018	36 786 509	%	115.490	98.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.06.2015	25.06.2018	27 992 189	%	87.150	99.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BBVA	EUR	1'000.00	25.06.2015	25.06.2018	27 992 188	%	95.330	99.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Itau Unibanc Sp ADR 20.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.215%	USD	1'000.00	25.06.2015	25.06.2018	28 370 915		-	96.140	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Commodities	USD	10'000.00	20.06.2017	25.06.2018	36 786 386	%	102.110	98.650	100.000		0.000	Y
7.79 % (7.75 % p.a.) Reverse Convertible on Avis Budget Grou Rg	USD	1'000.00	23.06.2017	25.06.2018	37 153 612	%	38.890	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 23.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.032%	USD	1'000.00	26.06.2015	26.06.2018	27 992 902		-	96.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.485%	USD	1'000.00	21.03.2017	26.06.2018	35 550 676		-	98.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.05.2017	26.06.2018	36 171 373	%	100.640	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 26.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	21.06.2017	26.06.2018	36 786 405		-	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.06.2017	26.06.2018	37 046 639	%	101.180	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on SGL Carbon	EUR	1'000.00	27.12.2016	27.06.2018	34 902 244	%	80.060	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	USD	1'000.00	03.04.2017	27.06.2018	35 550 755	%	131.960	98.240	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur GrpN	CHF	1'000.00	28.12.2015	28.06.2018	30 497 809	%	151.830	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	28.12.2015	28.06.2018	30 497 807	%	89.110	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	1'000.00	28.12.2015	28.06.2018	30 497 806	%	96.690	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Swiss Re N	CHF	1'000.00	28.12.2015	28.06.2018	30 497 810	%	89.910	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Swisscom N	CHF	1'000.00	28.12.2015	28.06.2018	30 497 808	%	109.250	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	1'000.00	28.12.2015	28.06.2018	30 497 805	%	124.620	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	28.12.2015	28.06.2018	30 497 802	%	131.620	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	28.12.2015	28.06.2018	30 497 801	%	112.220	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	1'000.00	28.12.2015	28.06.2018	30 497 799	%	115.440	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Novartis N	CHF	1'000.00	28.12.2015	28.06.2018	30 497 800	%	110.910	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.06.2016	28.06.2018	31 524 304	%	100.590	98.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.12.2016	28.06.2018	34 902 262		-	100.000	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.06.2017	28.06.2018	37 153 652	%	103.700	100.000	100.000		0.000	Y
8.3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	28.06.2017	28.06.2018	37 046 699	%	105.770	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	03.07.2015	29.06.2018	27 992 261	%	48.510	96.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.06.2016	29.06.2018	32 339 610	%	2.670	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.995%	USD	1'000.00	02.07.2015	02.07.2018	27 992 900		-	96.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.07.2015	02.07.2018	27 992 277	%	98.850	96.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.06.2016	02.07.2018	32 339 411	%	100.890	98.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.06.2017	02.07.2018	37 046 685	%	98.120	98.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.06.2017	02.07.2018	37 046 686	%	98.810	98.600	100.000		0.000	Y
Contingent Capital Protected-Cert. with reference bond	EUR	1'000.00	09.05.2013	03.07.2018	20 571 787	%	93.880	86.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.07.2015	03.07.2018	28 371 052	%	67.580	96.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.07.2015	03.07.2018	28 371 053	%	69.680	96.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 29.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.28%	GBP	1'000.00	03.07.2015	03.07.2018	27 992 917		-	95.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.07.2015	03.07.2018	27 992 302	%	85.450	96.200	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.07.2015	03.07.2018	27 992 303	%	18.400	96.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 31.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	14.12.2016	03.07.2018	34 765 547		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.086%	USD	1'000.00	03.01.2017	03.07.2018	35 135 265		-	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.086%	USD	1'000.00	03.01.2017	03.07.2018	35 135 266		-	97.980	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	50'000.00	28.06.2017	03.07.2018	36 786 607	%	124.260	98.600	100.000		0.000	Y
5.1 % Reverse Convertible on Julius Baer Grp N	CHF	1'000.00	03.07.2017	03.07.2018	37 046 763	%	103.930	100.000	100.000		0.000	Y
8.5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.07.2017	03.07.2018	37 046 746	%	99.280	100.000	100.000		0.000	Y
Contingent Capital Protected Certificate on Equities with credit risk	EUR	1'000.00	14.06.2013	04.07.2018	20 571 821	%	109.220	87.880	100.000		0.000	Y
Contingent Kapitalschutz-Zert. auf Basket mit reference bond	EUR	1'000.00	28.06.2013	04.07.2018	20 571 864	%	112.250	87.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Twitter	EUR	1'000.00	05.07.2016	05.07.2018	32 829 584	%	54.120	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	05.07.2016	05.07.2018	32 829 588	%	8.090	98.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.039%	USD	1'000.00	04.01.2017	05.07.2018	35 135 271		-	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.107%	USD	1'000.00	05.01.2017	05.07.2018	34 902 062		-	98.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 5.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	30.06.2017	05.07.2018	36 786 627		-	100.000	100.000		0.000	Y
4.57 % (5.5 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.09.2017	05.07.2018	37 749 869	%	98.740	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.872%	USD	1'000.00	06.07.2016	06.07.2018	32 339 351		-	98.580	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	500'000.00	30.06.2017	06.07.2018	36 786 629	%	110.240	98.900	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	500'000.00	30.06.2017	06.07.2018	36 786 628	%	103.690	98.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.07.2015	09.07.2018	27 992 278	%	34.320	96.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	09.07.2015	09.07.2018	27 992 858	%	82.800	95.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 5.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.707%	USD	1'000.00	09.07.2015	09.07.2018	28 371 069		-	96.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.07.2015	09.07.2018	27 992 332	%	6.210	96.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 11.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.004%	USD	1'000.00	30.06.2017	10.07.2018	37 046 778		-	98.560	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	50'000.00	05.07.2017	10.07.2018	37 046 693	%	121.740	98.590	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	50'000.00	05.07.2017	10.07.2018	37 046 678	%	120.950	98.590	100.000		0.000	Y
7.75 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.07.2017	10.07.2018	37 046 841	%	103.110	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on EURO STOXX Select Dividend 30	AUD	1'000.00	22.06.2015	11.07.2018	27 992 837	%	104.420	86.540	100.000		0.000	Y
7.55 % Reverse Convertible on Deutsche Bank N	EUR	1'000.00	11.07.2017	11.07.2018	37 046 862	%	101.900	100.000	100.000		0.000	Y
6.6 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.07.2017	11.07.2018	37 046 842	%	66.390	100.000	100.000		0.000	Y
8.01 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.07.2017	11.07.2018	37 046 850	%	99.440	100.000	100.000		0.000	Y
9 % Reverse Convertible on Abercrombie Ft Rg-A	USD	1'000.00	11.07.2017	11.07.2018	37 046 847	%	102.150	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.07.2017	11.07.2018	37 153 781	%	100.540	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.07.2016	12.07.2018	32 829 583	%	104.960	98.580	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on USD/RUB	USD	1'000.00	12.01.2017	12.07.2018	35 135 316	%	110.270	98.050	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Funds	USD	1'000.00	12.07.2017	12.07.2018	37 153 780	%	108.260	98.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	13.07.2015	13.07.2018	27 992 318	%	102.070	99.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 11.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.233%	USD	1'000.00	13.07.2015	13.07.2018	27 992 354		-	96.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.894%	USD	1'000.00	06.07.2016	13.07.2018	32 339 360		-	98.500	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 11.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.807%	USD	1'000.00	06.07.2016	13.07.2018	32 339 359		-	98.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Volkswagen Vz	EUR	1'000.00	13.07.2016	13.07.2018	32 829 612	%	95.080	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Volkswagen Vz	CHF	1'000.00	13.07.2016	13.07.2018	32 829 614	%	97.970	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Gogo Rg 15.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.01.2017	13.07.2018	35 327 673		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Abercrombie Ftch-A 15.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.01.2017	13.07.2018	35 327 675		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Wght Wtcher Intl Rg 15.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.01.2017	13.07.2018	35 327 674		-	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.07.2017	13.07.2018	37 046 892	%	101.260	100.000	100.000		0.000	Y
6.73 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.07.2017	13.07.2018	37 046 907	%	104.390	100.000	100.000		0.000	Y
8.5 % Reverse Convertible on Sotheby's Hld-A-LV	USD	1'000.00	13.07.2017	13.07.2018	37 046 896	%	99.120	100.000	100.000		0.000	Y
6.61 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.07.2017	13.07.2018	37 046 908	%	104.040	100.000	100.000		0.000	Y
6.98 % (7 % p.a.) Reverse Convertible on Abercrombie Ft Rg-A	CHF	1'000.00	14.07.2017	13.07.2018	37 046 848	%	105.040	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.317%	USD	1'000.00	15.01.2015	16.07.2018	25 924 276		-	95.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.07.2015	16.07.2018	28 370 924	%	103.930	96.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.852%	CAD	1'000.00	16.07.2015	16.07.2018	27 992 367		-	97.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 14.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.143%	GBP	1'000.00	16.07.2015	16.07.2018	27 992 359		-	96.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.835%	USD	1'000.00	07.07.2016	16.07.2018	32 339 376		-	98.540	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.117%	USD	1'000.00	07.07.2016	16.07.2018	32 339 375		-	98.540	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 13.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.982%	USD	1'000.00	13.04.2017	17.07.2018	36 170 845		-	98.230	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	18.07.2014	18.07.2018	24 204 950	%	97.150	92.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	18.01.2016	18.07.2018	30 497 851	%	87.700	97.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Casino Gp	EUR	1'000.00	18.07.2016	18.07.2018	32 339 533	%	96.130	100.000	100.000		0.000	Y
5.5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.07.2017	18.07.2018	37 153 828	%	95.120	100.000	100.000		0.000	Y
6.5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.07.2017	18.07.2018	37 153 829	%	97.400	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.07.2017	18.07.2018	37 153 830	%	99.760	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.07.2017	18.07.2018	37 153 831	%	99.400	100.000	100.000		0.000	Y
5.26 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.07.2017	18.07.2018	37 153 832	%	101.980	100.000	100.000		0.000	Y
5.92 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.07.2017	18.07.2018	37 153 833	%	101.870	100.000	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on CS Group N	CHF	1'000.00	18.07.2017	18.07.2018	37 153 827	%	102.150	100.000	100.000		0.000	Y
12.4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.07.2017	18.07.2018	37 153 826	%	102.290	100.000	100.000		0.000	Y
8.55 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.07.2017	18.07.2018	30 041 302	%	104.870	100.000	100.000		0.000	Y
8.96 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.07.2017	18.07.2018	30 041 303	%	103.830	100.000	100.000		0.000	Y
8.71 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.07.2017	18.07.2018	30 041 301	%	105.630	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities 18.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.344%	GBP	1'000.00	19.07.2013	19.07.2018	21 674 832		-	93.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on S&P GSCI Crd OilER	USD	1'000.00	22.07.2015	19.07.2018	27 992 361	%	69.530	96.670	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 16.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.146%	USD	1'000.00	20.01.2017	20.07.2018	35 135 218		-	98.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 18.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	20.01.2017	20.07.2018	35 135 182		-	98.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 20.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.866%	USD	1'000.00	17.07.2017	20.07.2018	37 153 800		-	98.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 20.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.866%	USD	1'000.00	17.07.2017	20.07.2018	37 153 801		-	98.560	100.000		0.000	Y
4.5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.07.2017	20.07.2018	37 153 877	%	96.790	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	AUD	1'000.00	23.07.2015	23.07.2018	27 992 396	%	95.800	93.080	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.07.2015	23.07.2018	28 781 851	%	97.460	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.07.2015	23.07.2018	27 992 416	%	4.060	96.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.07.2015	23.07.2018	27 992 408	%	101.750	96.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.07.2015	23.07.2018	27 992 407	%	102.800	96.420	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	23.01.2017	23.07.2018	30 041 246	%	114.690	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 20.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	24.07.2015	24.07.2018	28 781 836		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.07.2015	24.07.2018	28 781 837	%	103.720	99.430	100.000		0.000	Y
4.68 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	24.07.2017	24.07.2018	37 420 997	%	98.910	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	25.07.2013	25.07.2018	21 674 829	%	82.650	93.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.07.2016	25.07.2018	32 829 417	%	101.750	98.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.128%	USD	1'000.00	25.01.2017	25.07.2018	35 327 576		-	98.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.01.2017	25.07.2018	35 135 174	%	98.820	98.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	01.02.2017	25.07.2018	35 327 570		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.07.2017	25.07.2018	37 153 882	%	93.460	98.560	100.000		0.000	Y
6.42 % Reverse Convertible on Twitter Rg	CHF	1'000.00	26.07.2017	26.07.2018	30 041 308	%	101.770	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	27.07.2015	27.07.2018	27 992 434	%	95.130	95.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 25.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.265%	USD	1'000.00	27.07.2016	27.07.2018	33 244 688		-	98.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 16.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.124%	USD	1'000.00	26.01.2017	27.07.2018	35 135 217		-	98.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.073%	USD	1'000.00	27.01.2017	27.07.2018	35 327 641		-	97.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.973%	USD	1'000.00	27.01.2017	27.07.2018	35 448 022		-	97.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.073%	USD	1'000.00	27.01.2017	27.07.2018	35 327 642		-	97.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.863%	USD	1'000.00	20.07.2017	27.07.2018	37 153 887		-	98.550	100.000		0.000	Y
Protection Participation on EUR/USD	EUR	1'000.00	27.07.2017	27.07.2018	37 420 984	%	87.810	90.000	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.07.2017	27.07.2018	37 420 840	%	98.330	100.000	100.000	24.08. 25.09. 25.10. 24.11. 26.12.	1.157 1.162 1.187 1.174 1.187	N
8.2 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.07.2017	27.07.2018	37 420 851	%	99.940	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.07.2015	30.07.2018	27 992 417	%	64.340	96.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.07.2015	30.07.2018	28 781 799	%	97.640	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.07.2015	30.07.2018	28 781 800	%	93.630	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.233%	USD	1'000.00	28.07.2016	30.07.2018	33 244 699		-	98.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.01.2017	30.07.2018	35 448 027	%	99.950	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.07.2017	30.07.2018	37 046 744	%	90.400	98.510	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	31.07.2014	31.07.2018	24 204 997	%	114.130	92.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on S&P GSCI Crd OilER	USD	1'000.00	31.07.2015	31.07.2018	27 992 432	%	73.490	96.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.07.2015	31.07.2018	28 781 885	%	99.950	96.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.07.2015	31.07.2018	28 781 886	%	97.440	96.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 27.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.218%	USD	1'000.00	29.07.2016	31.07.2018	32 829 489		-	98.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Kite Pharma Rg 15.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.01.2017	31.07.2018	35 327 672		-	100.000	100.000		0.000	Y
8.9 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.01.2017	31.07.2018	35 327 703		-	100.000	100.000	01.03. 29.03. 27.04. 30.05. 29.06. 27.07. 29.08. 28.09.	1.135 1.122 1.119 1.097 1.076 1.084 1.066 1.093	N
Reverse Convertible on Equities 17.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.10%	USD	1'000.00	31.01.2017	31.07.2018	35 135 394		-	98.040	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 17.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.10%	USD	1'000.00	31.01.2017	31.07.2018	35 135 395		-	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.862%	USD	1'000.00	24.07.2017	31.07.2018	37 153 985		-	98.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.07.2017	31.07.2018	37 153 984	%	89.730	98.560	100.000		0.000	Y
7.81 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	31.07.2017	31.07.2018	37 420 884	%	101.330	100.000	100.000		0.000	Y
5.95 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	31.07.2017	31.07.2018	37 420 887	%	101.050	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 30.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.146%	USD	1'000.00	01.08.2016	01.08.2018	33 244 703		-	98.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 30.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	01.08.2016	01.08.2018	33 244 704		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	18.01.2017	01.08.2018	35 135 462		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Commodities	USD	1'000.00	02.08.2016	02.08.2018	33 244 705	%	98.120	98.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.02.2017	02.08.2018	35 448 057	%	110.260	97.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	5'000.00	02.02.2017	02.08.2018	35 327 878		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.07.2017	02.08.2018	37 420 812	%	104.910	98.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.07.2017	02.08.2018	37 420 821	%	71.940	98.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.07.2017	02.08.2018	37 420 822	%	101.750	98.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	26.07.2017	02.08.2018	37 154 003		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.07.2017	02.08.2018	37 154 005	%	99.040	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.07.2017	02.08.2018	37 154 004	%	97.960	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.07.2017	02.08.2018	37 154 006	%	101.360	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	26.07.2017	02.08.2018	37 154 002		-	100.000	100.000		0.000	Y
4.75 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.08.2017	02.08.2018	37 420 927	%	101.240	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.07.2016	03.08.2018	32 829 375	%	90.950	78.570	80.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	31.01.2017	03.08.2018	35 327 804		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.02.2017	03.08.2018	35 448 109	%	118.320	97.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.07.2017	03.08.2018	37 420 856	%	97.120	98.560	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	06.08.2013	06.08.2018	21 989 197	%	79.330	93.330	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	12.08.2013	06.08.2018	21 674 897	%	35.230	92.800	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	06.08.2014	06.08.2018	24 205 005	%	102.860	94.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.05.2015	06.08.2018	27 991 980	%	26.600	96.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.08.2015	06.08.2018	28 370 868	%	103.290	99.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.08.2015	06.08.2018	27 992 490	%	7.860	96.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.921%	USD	1'000.00	06.08.2015	06.08.2018	27 992 489		-	96.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.229%	USD	1'000.00	28.07.2016	06.08.2018	32 829 494		-	98.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Veolia Environn. 3.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	06.02.2017	06.08.2018	35 327 927		-	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	21.08.2013	07.08.2018	21 989 202	%	97.140	93.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	07.08.2015	07.08.2018	28 781 900	%	1.000	96.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Weatherford Int Rg	EUR	1'000.00	21.02.2017	07.08.2018	35 447 843	%	76.740	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Valeant Pharma I Rg 6.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	21.02.2017	07.08.2018	35 447 842		-	100.000	100.000		0.000	Y
Express-Cert. on shares-basket	EUR	1'000.00	08.08.2014	08.08.2018	24 565 273	%	4.460	98.020	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	08.02.2016	08.08.2018	30 040 819	%	92.470	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Orange	EUR	1'000.00	08.08.2016	08.08.2018	33 244 738	%	105.270	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.229%	USD	1'000.00	03.02.2017	08.08.2018	30 041 252		-	97.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.851%	USD	100.00	28.07.2017	08.08.2018	37 420 915		-	98.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	50'000.00	01.08.2017	08.08.2018	36 171 295		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	09.08.2016	09.08.2018	33 244 709	%	99.610	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 1.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.181%	USD	1'000.00	09.02.2017	09.08.2018	35 327 887		-	97.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.861%	USD	1'000.00	31.07.2017	09.08.2018	37 420 931		-	98.540	100.000		0.000	Y
7.5 % Reverse Convertible on US Steel Rg	USD	1'000.00	09.08.2017	09.08.2018	37 644 045	%	57.670	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.483%	USD	1'000.00	03.08.2016	10.08.2018	32 829 376		-	98.210	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	15.08.2016	10.08.2018	33 245 059	%	117.580	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BASF N	EUR	79.13	10.05.2017	10.08.2018	36 171 521	CHF	98.110	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Tesla Rg	CHF	1'000.00	10.08.2017	10.08.2018	37 421 085	%	94.450	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.921%	USD	1'000.00	13.08.2015	13.08.2018	28 370 969		-	96.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 10.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	13.08.2015	13.08.2018	27 992 519		-	96.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	13.08.2015	13.08.2018	27 992 522	%	98.560	96.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.08.2016	13.08.2018	32 829 377	%	100.890	98.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 10.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.27%	USD	1'000.00	11.08.2016	13.08.2018	33 245 062		-	98.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.056%	USD	1'000.00	13.02.2017	13.08.2018	35 327 932		-	97.990	100.000		0.000	Y
9.55 % (9.5 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.08.2017	13.08.2018	37 421 065	%	101.000	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.08.2017	14.08.2018	37 644 115	%	102.630	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.08.2017	14.08.2018	37 644 114	%	101.460	100.000	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	15.08.2013	15.08.2018	21 674 841	%	10.200	94.160	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	15.05.2017	15.08.2018	36 171 542	%	95.430	98.180	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Peugeot 13.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	15.05.2017	15.08.2018	36 171 198		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 15.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.525%	AUD	1'000.00	15.05.2017	15.08.2018	36 171 379		-	97.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.08.2017	15.08.2018	37 644 117	%	99.170	100.000	100.000		0.000	Y
6.25 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.08.2017	15.08.2018	37 643 867	%	102.540	100.000	100.000		0.000	Y
4.4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	15.08.2017	15.08.2018	37 643 866	%	102.300	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.08.2017	15.08.2018	37 644 116	%	100.210	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.08.2017	15.08.2018	37 644 118	%	98.740	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	16.08.2013	16.08.2018	21 989 223	%	80.100	92.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Novavax	USD	1'000.00	16.08.2016	16.08.2018	33 597 411	%	39.680	98.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.194%	USD	1'000.00	17.02.2017	17.08.2018	35 327 926		-	97.990	100.000		0.000	Y
7.5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.08.2017	17.08.2018	37 749 673	%	94.170	100.000	100.000		0.000	Y
6.5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.08.2017	17.08.2018	37 749 672	%	92.150	100.000	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	18.08.2014	20.08.2018	24 565 299	%	0.050	97.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.068%	USD	1'000.00	21.02.2017	20.08.2018	35 328 011		-	98.010	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	19.07.2017	20.08.2018	37 153 855	%	97.840	98.450	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Dongfeng Motor Gp-H	HKD	500'000.00	15.08.2017	20.08.2018	37 421 053	%	96.070	99.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	21.02.2014	21.08.2018	23 092 851	%	94.550	95.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.05.2017	21.08.2018	36 171 371	%	95.580	98.180	100.000		0.000	Y
6.5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.08.2017	21.08.2018	37 749 692	%	56.190	100.000	100.000		0.000	Y
9.4 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.08.2017	21.08.2018	37 749 689	%	105.710	100.000	100.000		0.000	Y
10.5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.08.2017	21.08.2018	37 749 687	%	65.950	100.000	100.000		0.000	Y
7.75 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.08.2017	21.08.2018	37 749 688	%	91.520	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.357%	GBP	1'000.00	22.02.2017	22.08.2018	35 448 117		-	99.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	22.02.2017	22.08.2018	35 447 880	%	91.820	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Oracle 19.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.419%	USD	1'000.00	23.08.2016	23.08.2018	33 244 922		-	98.110	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 21.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	23.02.2017	23.08.2018	35 447 766		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.98%	USD	1'000.00	23.02.2017	23.08.2018	35 550 998		-	97.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.02.2017	23.08.2018	35 447 890	%	97.930	97.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Societe Generale 19.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	23.02.2017	23.08.2018	35 447 903		-	100.000	100.000		0.000	Y
5.84 % Reverse Convertible on adidas N	EUR	1'000.00	23.08.2017	23.08.2018	37 644 024	%	90.990	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.992%	USD	1'000.00	21.02.2017	24.08.2018	35 447 820		-	97.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 22.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.663%	USD	1'000.00	24.02.2017	24.08.2018	35 447 891		-	97.880	100.000		0.000	Y
9.5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.08.2017	24.08.2018	37 749 690	%	62.330	100.000	100.000		0.000	Y
6.5 % (6.518106 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.08.2017	24.08.2018	37 749 691	%	91.670	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	USD	1'000.00	27.08.2013	27.08.2018	21 989 236	%	105.510	91.560	100.000	25.08.		Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.02.2016	27.08.2018	30 497 945	%	89.570	97.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.08.2016	27.08.2018	32 829 380	%	100.620	98.140	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	25.08.2016	27.08.2018	33 597 456	%	120.400	98.080	100.000		0.000	Y
4.8 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.08.2016	27.08.2018	33 244 822	%	100.890	100.000	100.000	23.02. 26.05. 24.08. 23.11.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Societe Generale 25.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.02.2017	27.08.2018	35 447 924		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	03.03.2017	27.08.2018	35 447 920	%	99.640	97.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.861%	USD	1'000.00	22.08.2017	27.08.2018	37 644 015		-	98.540	100.000		0.000	Y
6.87 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.08.2017	28.08.2018	37 749 525	%	94.700	100.000	100.000		0.000	Y
5.57 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.08.2017	28.08.2018	37 749 524	%	100.670	100.000	100.000		0.000	Y
6.61 % Reverse Convertible on BHP Billiton Sp ADR	USD	1'000.00	28.08.2017	28.08.2018	37 749 518	%	103.110	100.000	100.000		0.000	Y
11.1 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.08.2017	28.08.2018	37 749 738	%	63.300	100.000	100.000		0.000	Y
12.7 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.08.2017	28.08.2018	37 749 734	%	63.550	100.000	100.000		0.000	Y
6.4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.08.2017	28.08.2018	37 749 737	%	90.380	100.000	100.000		0.000	Y
7.61 % Reverse Convertible on Alibaba Grp Sp ADS	USD	1'000.00	28.08.2017	28.08.2018	37 749 519	%	101.530	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	29.08.2016	29.08.2018	33 245 040		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 20.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.995%	USD	1'000.00	28.02.2017	29.08.2018	35 447 840		-	97.920	100.000		0.000	Y
6.8 % Reverse Convertible on TevaPharmInd Sp ADR	USD	1'000.00	29.08.2017	29.08.2018	37 749 548	%	95.400	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.08.2016	30.08.2018	33 245 069	%	68.800	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.111%	USD	1'000.00	01.03.2017	30.08.2018	35 447 881		-	97.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.08.2016	31.08.2018	33 244 997	%	99.240	98.070	100.000		0.000	Y
5.9 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	31.08.2017	31.08.2018	37 749 735	%	88.660	100.000	100.000		0.000	Y
7.9 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.08.2017	31.08.2018	37 749 736	%	89.660	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	03.03.2017	03.09.2018	35 447 984		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Nokia Rg 1.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	03.03.2017	03.09.2018	35 447 960		-	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	04.09.2013	04.09.2018	21 989 204	%	11.100	91.740	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Tesco PLC	GBP	1'000.00	04.09.2014	04.09.2018	24 565 551	%	113.470	93.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 31.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.821%	USD	1'000.00	04.09.2015	04.09.2018	27 992 622		-	96.740	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.09.2015	04.09.2018	27 992 594	%	100.770	96.770	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.09.2016	04.09.2018	33 597 594	%	77.350	98.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.773%	USD	1'000.00	07.03.2017	04.09.2018	35 551 085		-	97.800	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
9.06 % Reverse Convertible on Equities 1.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	NOK	1'000.00	05.09.2016	05.09.2018	33 245 112		-	100.000	100.000	03.03. 01.06.	0.33724 0.32431	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.08.2017	05.09.2018	37 749 545	%	89.320	98.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Petroleo Br Sp ADR 1.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	28.08.2017	05.09.2018	37 749 546		-	98.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.096%	USD	1'000.00	06.09.2016	06.09.2018	33 245 132		-	98.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.062%	USD	1'000.00	09.03.2017	06.09.2018	35 447 989		-	97.930	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	06.06.2017	06.09.2018	36 786 469	%	97.460	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.08.2017	06.09.2018	37 749 561	%	98.910	98.540	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.08.2017	06.09.2018	37 749 562	%	98.710	98.540	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Renault	EUR	1'000.00	06.09.2017	06.09.2018	37 749 812	%	102.530	100.000	100.000		0.000	Y
8 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.09.2017	06.09.2018	37 749 939	%	69.300	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.08.2017	07.09.2018	37 749 645	%	97.970	98.560	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	50'000.00	05.09.2017	07.09.2018	37 749 729	%	106.780	98.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.09.2015	10.09.2018	27 992 651	%	98.700	99.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Mapfre	EUR	1'000.00	09.03.2017	10.09.2018	35 914 098	%	91.750	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.03.2017	10.09.2018	35 550 413	%	101.580	97.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Rite Aid Rg	EUR	1'000.00	20.03.2017	10.09.2018	35 550 678	%	48.730	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	50'000.00	05.09.2017	10.09.2018	37 749 748	%	105.210	98.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.09.2017	10.09.2018	37 749 794	%	95.350	98.580	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.873%	USD	1'000.00	06.09.2017	10.09.2018	37 749 796		-	98.580	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.09.2017	10.09.2018	37 749 793	%	83.190	98.580	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.873%	USD	1'000.00	06.09.2017	10.09.2018	37 749 800		-	98.580	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.09.2017	10.09.2018	37 749 799	%	99.060	98.580	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.09.2017	10.09.2018	37 749 798	%	97.530	98.580	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.873%	USD	1'000.00	06.09.2017	10.09.2018	37 749 797		-	98.580	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.09.2017	10.09.2018	37 749 792	%	95.850	98.580	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 9.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.104%	USD	1'000.00	11.09.2015	11.09.2018	27 992 659		-	96.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 9.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.104%	USD	1'000.00	11.09.2015	11.09.2018	27 992 660		-	96.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.657%	MXN	1'000.00	09.09.2016	11.09.2018	31 875 621		-	90.060	100.000		0.000	Y
3.97 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.03.2017	11.09.2018	35 551 051	%	100.030	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 11.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.873%	USD	1'000.00	07.09.2017	11.09.2018	37 749 851		-	98.570	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.09.2017	11.09.2018	37 749 862	%	91.260	98.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.09.2014	12.09.2018	24 205 143	%	100.520	94.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.09.2016	12.09.2018	33 597 591	%	55.140	98.020	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Deutsche Bank N	EUR	1'000.00	22.06.2017	12.09.2018	36 786 340	%	96.780	100.000	100.000		0.000	Y
15 % Reverse Convertible on Abercrombie Ft Rg-A	USD	1'000.00	12.09.2017	12.09.2018	37 749 980	%	105.610	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on JC Penney Rg	USD	1'000.00	12.09.2017	12.09.2018	38 126 809	%	80.260	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.09.2016	13.09.2018	33 597 824	%	103.630	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.941%	USD	1'000.00	13.09.2016	13.09.2018	33 597 514		-	97.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.067%	USD	1'000.00	13.03.2017	13.09.2018	35 914 110		-	97.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	13.03.2017	13.09.2018	35 447 994		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.084%	USD	1'000.00	13.03.2017	13.09.2018	35 550 478		-	97.810	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Equities	JPY	1'000'000.00	06.09.2017	13.09.2018	37 749 563	%	106.830	99.980	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	14.09.2016	14.09.2018	33 597 833	%	112.490	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.03.2017	14.09.2018	35 550 509	%	102.010	97.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.883%	USD	1'000.00	15.03.2017	14.09.2018	35 448 191		-	97.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	50'000.00	11.09.2017	14.09.2018	37 749 860	%	103.860	98.580	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Easyjet Rg	GBP	1'000.00	14.09.2017	14.09.2018	38 126 614	%	101.200	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Bayer N	EUR	1'000.00	14.09.2017	14.09.2018	38 126 612	%	95.800	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	EUR	1'000.00	14.09.2017	14.09.2018	38 126 607	%	98.800	95.000	95.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on BNP Paribas P-A	EUR	1'000.00	14.09.2017	14.09.2018	38 126 611	%	97.890	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	17.09.2014	17.09.2018	24 565 654	%	74.570	98.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.09.2014	17.09.2018	24 205 153	%	65.000	94.180	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 14.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.957%	EUR	1'000.00	17.09.2015	17.09.2018	27 992 703		-	99.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 14.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.957%	EUR	1'000.00	17.09.2015	17.09.2018	27 992 702		-	99.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.03.2017	17.09.2018	35 550 595	%	100.340	97.750	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Genl Dynamics Co Rg	USD	1'000.00	17.03.2017	17.09.2018	35 550 605	%	104.440	97.730	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.03.2017	17.09.2018	35 550 557	%	99.520	97.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	24.03.2017	17.09.2018	35 914 159		-	97.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	24.03.2017	17.09.2018	35 550 554		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on PICC Grp Cn -H-	HKD	500'000.00	12.09.2017	17.09.2018	37 749 648	%	98.500	99.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on BMW I	EUR	1'000.00	18.09.2017	18.09.2018	38 126 655	%	100.100	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Crude Oil 14.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.98%	USD	1'000.00	19.06.2017	19.09.2018	37 046 957		-	98.250	100.000		0.000	Y
4.51 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.09.2017	19.09.2018	38 126 674	%	99.950	100.000	100.000		0.000	Y
7.65 % Reverse Convertible on Deutsche Bank N	CHF	1'000.00	19.09.2017	19.09.2018	38 126 686	%	102.250	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Advanced Micro Dev. 20.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	14.10.2016	20.09.2018	34 080 710		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Ryl Caribbean Cr Rg 22.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.042% 22.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	17.03.2017	20.09.2018	35 550 596		-	97.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.03.2017	20.09.2018	35 550 640	%	97.550	97.730	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Novartis N	USD	1'000.00	20.06.2017	20.09.2018	36 786 520	%	99.080	100.000	100.000	18.09. 18.12.	3.432 3.523	N
7.8 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.09.2017	20.09.2018	38 126 714	%	81.280	100.000	100.000		0.000	Y
3.45 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.09.2017	20.09.2018	38 126 720	%	96.530	100.000	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.09.2017	20.09.2018	38 126 713	%	98.280	100.000	100.000		0.000	Y
Express-Cert. on Basket	USD	1'000.00	09.10.2013	24.09.2018	11 218 323	%	97.250	91.800	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Funds	USD	1'000.00	09.10.2013	24.09.2018	11 218 322	%	98.490	91.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 22.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.951%	EUR	1'000.00	24.09.2015	24.09.2018	27 992 717		-	99.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 22.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.04%	USD	1'000.00	24.03.2017	24.09.2018	35 550 716		-	97.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Vale Sp ADR 21.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.604%	USD	1'000.00	24.03.2017	24.09.2018	35 550 744		-	97.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.09.2014	25.09.2018	24 205 220	%	124.420	93.410	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.09.2015	25.09.2018	27 992 732	%	99.030	96.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	50'000.00	20.09.2017	25.09.2018	38 126 585	%	82.290	98.580	100.000		0.000	Y
12.5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.09.2017	26.09.2018	38 126 891	%	100.200	100.000	100.000		0.000	Y
7.25 % Reverse Convertible on Twitter Rg	USD	1'000.00	26.09.2017	26.09.2018	38 310 117	%	73.150	100.000	100.000		0.000	Y
11.75 % Reverse Convertible on Vertex Pharmaceu Rg	USD	1'000.00	26.09.2017	26.09.2018	38 126 892	%	95.740	100.000	100.000		0.000	Y
9.5 % Reverse Convertible on Alibaba Grp Sp ADS	USD	1'000.00	26.09.2017	26.09.2018	38 126 894	%	98.530	100.000	100.000		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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Deutsche Bank N 29.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.896%	USD	1'000.00	24.03.2017	27.09.2018	30 041 271		-	97.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.03.2017	27.09.2018	35 550 754	%	99.170	97.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.804%	USD	1'000.00	24.07.2017	27.09.2018	37 421 002		-	98.240	100.000		0.000	Y
11 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.09.2017	27.09.2018	38 310 137	%	95.020	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 26.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.608%	USD	1'000.00	28.03.2017	28.09.2018	35 550 766		-	97.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	28.03.2017	28.09.2018	35 914 320		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.10.2014	01.10.2018	24 205 256	%	82.320	93.740	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 29.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.323%	GBP	1'000.00	01.10.2014	01.10.2018	24 205 265		-	92.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.468%	USD	1'000.00	01.10.2014	01.10.2018	24 205 242		-	93.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 29.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.039%	USD	1'000.00	01.10.2015	01.10.2018	27 992 752		-	96.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	13.10.2015	01.10.2018	28 781 971	%	83.960	96.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	09.10.2014	02.10.2018	24 205 276	%	0.550	98.620	100.000		0.000	Y
9.5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.10.2017	02.10.2018	38 310 177	%	61.280	100.000	100.000		0.000	Y
9 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	02.10.2017	02.10.2018	38 310 176	%	60.890	100.000	100.000		0.000	Y
Capital Protected-Cert. Credit Linked on Bank of Ireland floating rate	EUR	1'000.00	23.08.2013	03.10.2018	21 674 800	%	98.150	87.280	100.000		0.000	Y
(9.6 % max.) Contingent Capital Protected Cert. on Basket with Refer ence Bond	EUR	1'000.00	20.09.2013	03.10.2018	21 989 231	%	97.190	87.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.284%	USD	1'000.00	03.10.2016	03.10.2018	33 851 065		-	97.990	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 29.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.163%	USD	1'000.00	03.04.2017	03.10.2018	35 914 228		-	97.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.914%	USD	1'000.00	03.04.2017	03.10.2018	35 914 232		-	97.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 29.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.188%	USD	1'000.00	03.04.2017	03.10.2018	35 914 335		-	97.850	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	03.07.2017	03.10.2018	37 153 686	%	97.610	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	100'000.00	28.09.2017	03.10.2018	38 126 734	%	87.360	98.540	100.000		0.000	Y
Structured Note Credit Linked on EMIRATES 24.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	10'000.00	20.02.2015	04.10.2018	26 674 604		-	94.978	100.000		0.000	Y
Structured Note Credit Linked on EFG/NC	USD	10'000.00	20.02.2015	04.10.2018	25 924 005	%	102.500	94.330	100.000		0.000	Y
Structured Note Credit Linked on EFG/NC	USD	10'000.00	20.02.2015	04.10.2018	25 924 004	%	102.080	95.410	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	04.10.2016	04.10.2018	34 080 720	%	70.880	98.010	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	04.04.2017	04.10.2018	36 171 052	%	113.620	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.10.2017	04.10.2018	38 310 186	%	88.510	100.000	100.000		0.000	Y
10.7 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.10.2017	04.10.2018	38 310 185	%	62.780	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.907%	USD	1'000.00	05.04.2017	05.10.2018	35 914 233		-	97.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ArcelorMittal Reg	EUR	1'000.00	05.04.2017	05.10.2018	35 914 380	%	104.010	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	06.04.2017	05.10.2018	36 171 077		-	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on The Swatch Grp I	CHF	1'000.00	05.07.2017	05.10.2018	37 153 635	%	101.270	100.000	100.000	02.10.	0.000	N
Protection Participation on Gold 1 Uz	EUR	1'000.00	05.10.2017	05.10.2018	38 486 116	%	95.470	90.000	90.000		0.000	Y
9 % Reverse Convertible on TevaPharmInd Sp ADR	EUR	1'000.00	05.10.2017	05.10.2018	38 310 026	%	95.760	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Gold 1 Uz	USD	1'000.00	05.10.2017	05.10.2018	38 486 117	%	94.900	86.620	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 6.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.10.2015	08.10.2018	28 782 090		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.10.2017	08.10.2018	38 309 987	%	100.240	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.10.2017	08.10.2018	38 309 986	%	100.780	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.04.2017	09.10.2018	35 914 230	%	100.460	97.780	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	18.09.2013	10.10.2018	22 226 789	%	17.010	91.240	100.000	11.10.		Y
Reverse Convertible on Indices 6.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	10.10.2016	10.10.2018	33 851 119		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	10.04.2017	10.10.2018	36 170 791	%	131.910	97.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 5.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.601%	USD	1'000.00	10.04.2017	10.10.2018	36 170 812		-	97.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 5.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.588%	USD	1'000.00	10.04.2017	10.10.2018	36 170 782		-	97.810	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Funds	USD	50'000.00	04.10.2017	10.10.2018	25 932 935	%	103.920	98.480	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	13.10.2014	12.10.2018	25 445 152	%	125.370	99.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.579%	USD	1'000.00	12.04.2017	12.10.2018	35 914 387		-	97.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.573%	USD	1'000.00	27.04.2017	12.10.2018	36 171 327		-	97.870	100.000		0.000	Y
7.02 % (7 % p.a.) Reverse Convertible on Deutsche Bank N	USD	1'000.00	11.10.2017	12.10.2018	38 486 158	%	89.880	100.000	100.000		0.000	Y
8.02 % (8 % p.a.) Reverse Convertible on TevaPharmInd Sp ADR	USD	1'000.00	11.10.2017	12.10.2018	38 486 157	%	79.010	100.000	100.000		0.000	Y
7.23 % (7.25 % p.a.) Reverse Convertible on TevaPharmInd Sp ADR	USD	1'000.00	13.10.2017	12.10.2018	38 310 207	%	94.050	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.04.2016	15.10.2018	31 524 640	%	67.000	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Goldcorp	USD	1'000.00	14.10.2016	15.10.2018	34 080 795	%	61.860	97.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.10.2014	16.10.2018	25 445 078	%	0.050	98.730	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.285%	USD	1'000.00	06.10.2016	16.10.2018	33 851 169		-	97.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.325%	USD	1'000.00	11.10.2016	16.10.2018	33 851 223		-	97.980	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.10.2017	16.10.2018	38 309 993	%	100.050	98.450	100.000		0.000	Y
8.3 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.10.2017	16.10.2018	38 310 344	%	98.200	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	05.10.2016	17.10.2018	34 080 735		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Apple 18.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.141%	USD	1'000.00	05.10.2016	17.10.2018	34 080 718		-	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.177%	USD	1'000.00	17.10.2016	17.10.2018	33 851 292		-	97.890	100.000		0.000	Y
6.37 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.10.2017	17.10.2018	38 310 398	%	101.470	100.000	100.000		0.000	Y
6.1 % Reverse Convertible on Apple Rg	USD	1'000.00	17.10.2017	17.10.2018	38 310 378	%	97.870	100.000	100.000		0.000	Y
3.18 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.10.2017	17.10.2018	38 310 395	%	99.530	100.000	100.000		0.000	Y
3.1 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.10.2017	17.10.2018	38 310 407	%	98.060	100.000	100.000		0.000	Y
5.81 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.10.2017	17.10.2018	38 310 396	%	100.160	100.000	100.000		0.000	Y
12.17 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.10.2017	17.10.2018	38 310 397	%	102.150	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	18.10.2016	18.10.2018	33 851 320		-	97.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	18.10.2016	18.10.2018	33 851 177		-	97.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.04.2017	18.10.2018	36 170 801	%	101.550	97.790	100.000		0.000	Y
9.5 % Reverse Convertible on Tesla Rg	USD	1'000.00	18.07.2017	18.10.2018	37 153 712	%	98.670	100.000	100.000	16.10.	3.656	N
9.03 % (9 % p.a.) Reverse Convertible on TevaPharmInd Sp ADR	USD	1'000.00	17.10.2017	18.10.2018	38 310 389	%	94.160	100.000	100.000		0.000	Y
8.02 % (8 % p.a.) Reverse Convertible on Deutsche Bank N	USD	1'000.00	17.10.2017	18.10.2018	38 310 388	%	93.310	100.000	100.000		0.000	Y
10 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.10.2017	18.10.2018	38 310 203	%	102.310	100.000	100.000		0.000	N
Reverse Convertible on Equities 17.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	19.10.2016	19.10.2018	33 851 376		-	97.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	19.10.2016	19.10.2018	33 851 377		-	97.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 5.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.954%	USD	1'000.00	26.04.2017	19.10.2018	36 171 270		-	97.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.08.2017	19.10.2018	37 420 983	%	88.510	98.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Commodities	USD	1'000.00	16.10.2017	19.10.2018	38 310 332	%	101.680	98.430	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.10.2017	19.10.2018	30 041 356	%	96.250	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Uncapped Capital Protection on Swiss Market Index	CHF	1'000.00	22.10.2010	22.10.2018	11 589 013	%	120.380	87.800	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	22.10.2013	22.10.2018	22 226 777	%	134.020	91.560	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Equities 18.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.703%	EUR	1'000.00	22.10.2013	22.10.2018	22 406 536		-	93.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 21.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.281%	CAD	1'000.00	22.10.2015	22.10.2018	28 782 158		-	97.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 21.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.026%	USD	1'000.00	22.10.2015	22.10.2018	28 782 173		-	97.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.10.2017	22.10.2018	38 485 541	%	96.360	98.410	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Best Buy Rg	EUR	1'000.00	18.10.2017	22.10.2018	38 486 211	%	81.920	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Michael Kors Rg	EUR	1'000.00	18.10.2017	22.10.2018	38 486 210	%	70.580	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Twitter Rg	EUR	1'000.00	18.10.2017	22.10.2018	38 486 212	%	70.670	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	23.10.2014	23.10.2018	25 445 252	%	101.850	94.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.04.2015	23.10.2018	26 674 106	%	89.990	95.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.262%	USD	1'000.00	24.10.2016	24.10.2018	33 851 427		-	97.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 20.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.257%	USD	1'000.00	24.10.2016	24.10.2018	33 851 430		-	97.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.142%	USD	1'000.00	24.10.2016	24.10.2018	33 851 379		-	97.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.182%	USD	1'000.00	24.10.2016	24.10.2018	33 851 388		-	97.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Inditex	EUR	1'000.00	24.04.2017	24.10.2018	36 170 866	%	91.750	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on AXA 20.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	24.04.2017	24.10.2018	36 170 865		-	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	25.10.2013	25.10.2018	22 406 531	%	104.510	91.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.445%	USD	1'000.00	25.04.2017	25.10.2018	36 170 908		-	97.920	100.000		0.000	Y
9.8 % Reverse Convertible on Equities 24.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	26.10.2016	26.10.2018	34 080 777		-	100.000	100.000	24.04. 24.10.	5.176 5.146	N
13.92 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.07.2017	26.10.2018	37 420 813	%	99.710	100.000	100.000	24.08. 22.09. 24.10. 23.11. 22.12.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
11.77 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.07.2017	26.10.2018	37 420 817	%	97.860	100.000	100.000	24.08. 22.09. 24.10. 23.11. 22.12.	0.000 0.000 0.000 0.000 0.000	N
6.25 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.10.2017	26.10.2018	38 485 708	%	100.480	100.000	100.000		0.000	Y
6.5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.10.2017	26.10.2018	38 485 710	%	98.740	100.000	100.000		0.000	Y
9.5 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.10.2017	26.10.2018	38 485 709	%	99.120	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.10.2014	29.10.2018	25 822 893	%	63.220	94.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.10.2017	30.10.2018	38 485 685	%	98.260	98.390	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.939%	USD	1'000.00	31.10.2016	31.10.2018	34 080 890		-	97.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.284%	USD	1'000.00	31.10.2016	31.10.2018	34 080 476		-	97.970	100.000		0.000	Y
8.9 % Reverse Convertible on TechnipFMC	CHF	1'000.00	31.10.2016	31.10.2018	34 080 509	%	97.740	100.000	100.000	27.01. 27.04. 27.07. 27.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.10.2017	31.10.2018	38 485 731	%	104.870	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.10.2016	01.11.2018	33 851 184	%	100.460	97.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	01.11.2016	01.11.2018	34 080 828	%	156.640	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 29.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.08%	USD	1'000.00	28.04.2017	01.11.2018	36 170 960		-	97.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 29.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.08%	USD	1'000.00	28.04.2017	01.11.2018	36 170 961		-	97.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.36%	USD	1'000.00	28.04.2017	01.11.2018	36 170 963		-	97.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.05.2017	01.11.2018	36 171 320	%	99.720	97.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.10.2016	02.11.2018	33 851 197	%	103.240	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.836%	USD	1'000.00	28.04.2017	02.11.2018	36 171 459		-	97.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on S&P GSCI Excess Ret	USD	1'000.00	23.10.2017	02.11.2018	38 485 608	%	101.550	98.410	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.10.2014	05.11.2018	25 445 054	%	87.520	93.560	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	05.11.2014	05.11.2018	25 923 919	%	120.820	94.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.11.2015	05.11.2018	30 040 746	%	86.850	99.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	16.11.2015	05.11.2018	29 348 209	%	55.820	96.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on VanEck Gold Miners	EUR	1'000.00	05.05.2017	05.11.2018	36 170 934	%	100.280	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.05.2017	05.11.2018	36 171 147	%	90.200	97.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 5.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.242%	USD	1'000.00	12.05.2017	05.11.2018	36 171 488		-	97.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 5.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.242%	USD	1'000.00	12.05.2017	05.11.2018	36 171 487		-	97.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.10.2016	06.11.2018	34 080 460	%	87.070	97.960	100.000		0.000	Y
9.8 % Reverse Convertible on TevaPharmInd Sp ADR	USD	1'000.00	06.11.2017	06.11.2018	38 485 864	%	97.980	100.000	100.000		0.000	Y
3 1/2 % Reverse Convertible on Equities 3.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	05.11.2015	07.11.2018	30 040 739		-	99.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.584%	CAD	1'000.00	25.10.2016	07.11.2018	33 851 452		-	98.100	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	GBP	1'000.00	07.11.2016	07.11.2018	34 443 749	%	100.500	98.790	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	GBP	1'000.00	07.11.2016	07.11.2018	34 443 748	%	85.090	98.790	100.000		0.000	Y
4.2 % Reverse Convertible on Indices 31.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	07.11.2016	07.11.2018	34 080 816		-	100.000	100.000	02.05. 31.10.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.11.2017	07.11.2018	38 485 968	%	90.690	98.380	100.000		0.000	Y
6.32 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.11.2017	07.11.2018	38 486 391	%	99.710	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 4.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.104%	GBP	1'000.00	08.05.2015	08.11.2018	27 991 985		-	95.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Pier 1 Imports Inc 9.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	22.11.2016	08.11.2018	34 443 894		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.05.2017	08.11.2018	36 171 158	%	96.210	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	08.11.2017	08.11.2018	38 485 900	%	95.020	93.490	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 7.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.107%	USD	1'000.00	02.11.2016	09.11.2018	33 851 186		-	97.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on S&P GSCI Crd OilER 7.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.889%	USD	1'000.00	09.11.2016	09.11.2018	34 443 809		-	97.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.05.2017	09.11.2018	36 171 173	%	98.620	97.830	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	HKD	100'000.00	07.11.2017	09.11.2018	38 486 327	%	94.490	98.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.11.2014	13.11.2018	25 923 945	%	27.790	98.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.11.2014	13.11.2018	25 923 944	%	0.100	98.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Banco Santander	EUR	1'000.00	13.11.2014	13.11.2018	25 923 920	%	112.360	98.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 10.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.273%	USD	1'000.00	13.05.2015	13.11.2018	26 674 350		-	95.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 10.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.429%	USD	1'000.00	13.11.2015	13.11.2018	28 782 241		-	96.570	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 2.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.925%	USD	1'000.00	11.05.2017	13.11.2018	36 171 149		-	97.840	100.000		0.000	Y
6.67 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.11.2017	13.11.2018	30 041 430	%	98.800	100.000	100.000		0.000	Y
5.34 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.11.2017	13.11.2018	30 041 429	%	98.840	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	14.11.2013	14.11.2018	22 406 682	%	101.640	91.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.11.2017	14.11.2018	38 486 005	%	97.700	98.370	100.000		0.000	Y
7.55 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.11.2017	14.11.2018	39 034 354	%	98.960	100.000	100.000		0.000	Y
5.55 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.11.2017	14.11.2018	39 034 355	%	98.950	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.11.2016	15.11.2018	34 081 022	%	101.120	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	15.11.2016	15.11.2018	34 540 720		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Actelion N 11.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	15.11.2016	15.11.2018	34 081 014		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Air France - KLM 13.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.257%	USD	1'000.00	15.05.2017	15.11.2018	36 171 181		-	97.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 12.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.145%	USD	1'000.00	16.11.2016	16.11.2018	34 443 621		-	97.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Engie 7.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	16.05.2017	16.11.2018	36 171 165		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.578%	USD	1'000.00	16.05.2017	16.11.2018	36 171 358		-	97.780	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Funds	USD	1'000.00	29.11.2013	19.11.2018	22 406 662	%	98.260	92.730	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	19.11.2014	19.11.2018	25 822 913	%	76.810	94.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.05.2015	19.11.2018	26 674 408	%	104.300	95.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.11.2015	19.11.2018	28 782 275	%	100.440	99.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 12.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	19.11.2015	19.11.2018	28 782 277		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.351%	USD	1'000.00	19.05.2017	19.11.2018	36 171 405		-	97.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 16.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.99%	EUR	1'000.00	20.11.2015	20.11.2018	30 041 147		-	99.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.05.2017	20.11.2018	36 171 377	%	80.930	97.780	100.000		0.000	Y
4.8 % Reverse Convertible on Nike -B-	USD	1'000.00	20.11.2017	20.11.2018	38 486 488	%	99.360	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Shake Shack Rg-A	USD	1'000.00	20.11.2017	20.11.2018	38 486 489	%	98.840	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.11.2014	21.11.2018	25 923 954	%	59.830	94.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.11.2016	21.11.2018	34 540 783	%	75.520	97.700	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Casino Gp 20.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	22.11.2016	22.11.2018	34 443 854		-	100.000	100.000		0.000	Y
6 % (5.97 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.11.2017	22.11.2018	39 034 381	%	97.050	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	23.05.2014	23.11.2018	24 205 663	%	90.620	96.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.11.2015	23.11.2018	30 040 775	%	6.920	96.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 17.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	23.11.2016	23.11.2018	34 443 728		-	97.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.427%	USD	1'000.00	23.05.2017	23.11.2018	36 171 613		-	97.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.05.2017	23.11.2018	36 171 412	%	101.520	97.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.482%	USD	1'000.00	17.08.2017	23.11.2018	37 643 990		-	98.180	100.000		0.000	Y
6 % (5.95 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	23.11.2018	39 034 382	%	95.490	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Gold 1 Uz	USD	1'000.00	20.11.2017	23.11.2018	39 034 383	%	92.880	88.500	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on EDF	EUR	1'000.00	26.05.2016	26.11.2018	31 185 652	%	144.730	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.05.2017	26.11.2018	36 171 681	%	90.430	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on NATIXIS 22.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	26.05.2017	26.11.2018	36 171 665		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.05.2017	26.11.2018	36 171 757	%	100.770	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	26.11.2018	38 485 818	%	98.660	98.340	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	50'000.00	21.11.2017	26.11.2018	39 034 357	%	100.030	98.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 25.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.666%	CAD	1'000.00	27.05.2015	27.11.2018	26 674 474		-	95.580	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 25.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.11.2015	27.11.2018	28 782 281		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.209%	USD	1'000.00	24.05.2017	27.11.2018	36 171 399		-	97.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.503%	USD	1'000.00	26.05.2017	27.11.2018	36 171 428		-	97.870	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on China Mobile Rg	USD	50'000.00	22.11.2017	27.11.2018	38 485 784	%	97.140	98.340	100.000		0.000	Y
5 % (4.96 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.11.2017	27.11.2018	39 034 554	%	95.430	100.000	100.000		0.000	Y
6 % (5.95 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.11.2017	27.11.2018	39 034 553	%	99.000	100.000	100.000		0.000	Y
5 % (4.96 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.11.2017	27.11.2018	39 034 551	%	96.520	100.000	100.000		0.000	Y
6 % (5.95 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.11.2017	27.11.2018	39 034 552	%	95.230	100.000	100.000		0.000	Y
5.4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.11.2017	27.11.2018	39 034 409	%	99.270	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	28.11.2014	28.11.2018	25 924 078	%	65.680	94.480	100.000		0.000	Y
11.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	28.11.2017	28.11.2018	39 164 183	%	100.370	100.000	100.000		0.000	Y
7.1 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.11.2017	28.11.2018	38 486 494	%	97.260	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	05.06.2015	29.11.2018	26 674 487	%	95.070	95.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	05.06.2015	29.11.2018	26 674 488	%	99.520	95.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Telefonica Br	EUR	1'000.00	18.05.2017	29.11.2018	36 171 604	%	85.740	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.11.2015	30.11.2018	29 347 788	%	80.490	96.510	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	200'000.00	23.11.2016	30.11.2018	34 443 610	%	79.850	97.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.05.2017	30.11.2018	36 786 145	%	93.600	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.11.2017	30.11.2018	39 034 444	%	95.830	98.290	100.000		0.000	Y
5.03 % (5 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.11.2017	30.11.2018	39 164 178	%	92.420	100.000	100.000		0.000	Y
6.03 % (6 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.11.2017	30.11.2018	39 164 179	%	94.460	100.000	100.000		0.000	Y
5.03 % (5 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.11.2017	30.11.2018	39 164 180	%	89.120	100.000	100.000		0.000	Y
5.03 % (5 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.11.2017	30.11.2018	39 164 182	%	88.030	100.000	100.000		0.000	Y
5.03 % (5 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.11.2017	30.11.2018	39 164 181	%	94.270	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.12.2014	03.12.2018	25 924 089	%	91.570	98.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.12.2014	03.12.2018	25 923 858	%	92.620	94.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	03.12.2014	03.12.2018	25 923 859	%	93.030	94.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.12.2014	03.12.2018	25 924 093	%	62.010	94.330	100.000		0.000	Y
5 % Underlying Tracker on Telefonica Br	EUR	1'000.00	30.05.2017	03.12.2018	36 171 709	%	97.770	100.000	100.000	04.09. 05.12.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.11.2017	03.12.2018	39 034 488	%	101.180	98.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 1.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	04.12.2015	04.12.2018	29 347 800		-	100.000	100.000		0.000	Y
4.6 % (4.561983 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	01.12.2017	04.12.2018	39 164 193	%	98.610	100.000	100.000		0.000	Y
5.9 % (5.85124 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	01.12.2017	04.12.2018	39 164 194	%	96.910	100.000	100.000		0.000	Y
2.69 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.12.2017	04.12.2018	30 041 470	%	99.000	100.000	100.000		0.000	Y
3.77 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.12.2017	04.12.2018	30 041 471	%	99.290	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 3.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	05.12.2016	05.12.2018	34 540 666		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 3.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.137% 3.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	05.12.2016	05.12.2018	34 540 665		-	97.410	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.06.2017	05.12.2018	36 786 227	%	97.090	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.402%	USD	1'000.00	05.06.2017	05.12.2018	36 786 230		-	97.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	05.06.2017	05.12.2018	36 786 229		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.06.2017	05.12.2018	36 786 228	%	98.070	97.880	100.000		0.000	Y
11.12 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.09.2017	05.12.2018	37 749 632	%	98.160	100.000	100.000	03.10. 02.11. 01.12.	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	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
9.02 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.09.2017	05.12.2018	37 749 643		n.v.	100.000	100.000	03.10. 02.11. 01.12.	0.000 0.000 0.000	N
8.77 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.09.2017	05.12.2018	37 749 635	%	99.620	100.000	100.000	03.10. 02.11. 01.12.	0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Nokia 3.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	06.12.2016	06.12.2018	34 540 713		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.06.2017	06.12.2018	36 786 231	%	70.770	100.000	100.000		0.000	Y
11 % Reverse Convertible on LendingClub Rg	CHF	1'000.00	06.09.2017	06.12.2018	37 749 756	%	83.550	100.000	100.000	01.12.	0.000	N
9.1 % Reverse Convertible on Idorsia Rg	CHF	1'000.00	06.12.2017	06.12.2018	30 041 474	%	103.260	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.585%	USD	1'000.00	07.12.2016	07.12.2018	34 540 885		-	97.450	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Richemont N	CHF	1'000.00	07.12.2016	07.12.2018	34 540 877	%	122.160	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Mylan Br	EUR	1'000.00	07.06.2017	07.12.2018	36 786 271	%	98.930	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Shire Rg	EUR	1'000.00	07.06.2017	07.12.2018	36 786 248	%	85.990	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Deutsche Bank N	CHF	1'000.00	07.06.2017	07.12.2018	36 786 245	%	96.620	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	10.12.2015	10.12.2018	30 041 154	%	108.150	96.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.265%	USD	1'000.00	10.12.2015	10.12.2018	30 041 159		-	96.340	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.12.2017	11.12.2018	39 164 222	%	99.370	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Barrick Gold Rg	CHF	1'000.00	12.06.2017	12.12.2018	36 786 331	%	97.600	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	12.09.2017	12.12.2018	37 749 971	%	98.870	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	12.09.2017	12.12.2018	38 126 812	%	109.030	98.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Avis Budget Group 14.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	02.01.2017	13.12.2018	34 902 031		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Avon Products	EUR	1'000.00	02.01.2017	13.12.2018	34 902 032	%	49.920	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Seagate Technology 13.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	02.01.2017	13.12.2018	34 902 029		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Tesla Motors 13.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	02.01.2017	13.12.2018	34 902 030		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.06.2017	13.12.2018	37 046 919	%	86.280	97.880	100.000		0.000	Y
8.43 % Reverse Convertible on Equities	NOK	1'000.00	13.12.2017	13.12.2018	39 164 052	%	100.550	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.06.2017	14.12.2018	36 786 183	%	101.990	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Alcoa-WI Rg 14.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.429%	USD	1'000.00	13.06.2017	14.12.2018	36 786 259		-	97.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Micron Technolog Rg 14.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.422%	USD	1'000.00	13.06.2017	14.12.2018	36 786 260		-	97.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Sina Corporation 14.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.429%	USD	1'000.00	13.06.2017	14.12.2018	36 786 261		-	97.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on VanEck Gold Miners 12.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.412%	USD	1'000.00	14.06.2017	14.12.2018	36 786 481		-	97.890	100.000		0.000	Y
5.3 % Reverse Convertible on Henkel Vz I	EUR	1'000.00	14.12.2017	14.12.2018	39 164 074	%	98.330	100.000	100.000		0.000	Y
8.3 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.12.2017	14.12.2018	39 164 251	%	97.740	100.000	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	14.12.2017	14.12.2018	39 164 075	%	100.100	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Daimler N	EUR	1'000.00	14.12.2017	14.12.2018	39 164 073	%	100.520	100.000	100.000		0.000	Y
5.2 % Reverse Convertible on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	14.12.2017	14.12.2018	39 164 072	%	101.130	100.000	100.000		0.000	Y
5.1 % Reverse Convertible on Unilever Cert	EUR	1'000.00	14.12.2017	14.12.2018	39 164 071	%	97.600	100.000	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Total	EUR	1'000.00	14.12.2017	14.12.2018	39 164 070	%	98.700	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	10.12.2015	17.12.2018	29 347 796	%	98.990	96.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 13.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.596%	USD	1'000.00	17.12.2015	17.12.2018	29 347 834		-	96.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 13.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.596%	USD	1'000.00	17.12.2015	17.12.2018	29 347 835		-	96.280	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 14.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.398%	USD	1'000.00	13.06.2017	17.12.2018	36 786 440		-	97.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	16.06.2017	17.12.2018	37 046 981	%	99.260	97.830	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CGG	EUR	1'000.00	18.12.2015	18.12.2018	30 041 208	%	3.530	99.970	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	19.12.2016	19.12.2018	34 765 592	%	108.520	97.390	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.764%	USD	1'000.00	19.12.2016	19.12.2018	34 765 657		-	97.390	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 15.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.431%	USD	1'000.00	19.12.2016	19.12.2018	34 765 694		-	97.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.06.2017	19.12.2018	36 786 555	%	83.290	97.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.62%	USD	1'000.00	19.06.2017	19.12.2018	36 786 531		-	97.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 15.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.36%	USD	1'000.00	19.06.2017	19.12.2018	37 046 964		-	97.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 15.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	19.06.2017	19.12.2018	37 046 965		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.371%	USD	1'000.00	19.06.2017	19.12.2018	36 786 557		-	97.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Activision Blizz Rg 21.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	07.06.2017	20.12.2018	36 786 272		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Activision Blizz Rg 21.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	12.09.2017	20.12.2018	37 749 984		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	NZD	1'000.00	19.12.2017	20.12.2018	39 164 336	%	99.480	98.030	100.000		0.000	Y
Uncapped Capital Protection on Swiss Market Index	CHF	1'000.00	22.12.2010	21.12.2018	11 817 323	%	119.560	85.150	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities 19.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	21.12.2016	21.12.2018	34 765 633		-	100.000	100.000	19.06. 19.12.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Equities 19.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	21.06.2017	21.12.2018	36 786 618		-	97.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.06.2015	24.12.2018	28 370 803	%	87.230	95.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.06.2015	24.12.2018	28 370 837	%	88.390	98.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.06.2015	24.12.2018	27 992 206	%	98.320	98.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.06.2015	24.12.2018	27 992 223	%	99.440	95.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on EDF 21.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	30.06.2016	24.12.2018	31 524 325		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Total	EUR	1'000.00	23.10.2017	24.12.2018	38 485 578	%	100.300	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 23.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.074%	USD	1'000.00	20.12.2016	26.12.2018	34 443 785		-	97.350	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	50'000.00	20.12.2017	26.12.2018	39 164 050	%	98.500	98.210	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Vulcan Materials	USD	1'000.00	27.12.2016	27.12.2018	34 901 949	%	103.940	97.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.06.2017	27.12.2018	37 046 674	%	95.220	97.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Royal Dutch Shell-A 21.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.06.2017	27.12.2018	37 046 636		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.12.2017	27.12.2018	39 164 163	%	99.400	98.170	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	28.12.2015	28.12.2018	30 497 803	%	123.770	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on S&P GSCI Crd Oil ER	USD	1'000.00	28.12.2016	28.12.2018	34 902 243	%	110.720	97.050	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Novo Nordisk -B-	SEK	10'000.00	28.12.2016	28.12.2018	34 765 645	%	114.170	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on NVIDIA 26.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	13.01.2017	28.12.2018	35 135 085		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.363%	USD	1'000.00	28.06.2017	28.12.2018	37 046 675		-	97.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	29.12.2016	02.01.2019	34 902 095	%	86.400	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Gap 3.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	13.01.2017	02.01.2019	35 135 086		-	100.000	100.000		0.000	Y
Capital Protection-Cert. with reference bond	USD	50'000.00	15.10.2013	03.01.2019	21 674 850	%	97.730	85.360	100.000		0.000	Y
Cert. with credit risk on Goldman Sachs Group	USD	50'000.00	15.10.2013	03.01.2019	22 406 526	%	99.250	85.360	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Capital Protection-Cert. on EFGAM	USD	50'000.00	15.10.2013	03.01.2019	22 406 524	%	99.730	85.360	100.000		0.000	Y
Cert. with credit risk on Goldman Sachs Group	USD	50'000.00	15.10.2013	03.01.2019	22 406 525	%	99.980	85.360	100.000		0.000	Y
(9 % max.) Credit Linked Note Credit Linked on Bank of Ireland	EUR	1'000.00	10.12.2013	03.01.2019	22 406 512	%	95.490	91.710	100.000		0.000	Y
(9 % max.) Contingent Capital Protected-Cert. on basket with refe rence bond	EUR	1'000.00	10.12.2013	03.01.2019	22 406 513	%	95.630	91.480	100.000		0.000	Y
Capital Protection-Cert.	USD	1'000.00	18.12.2013	03.01.2019	23 092 640	%	96.050	87.650	100.000		0.000	Y
Capital Protection-Cert. on USDJPY Exchange Rate	USD	1'000.00	18.12.2013	03.01.2019	23 092 629	%	103.660	86.330	98.500		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.01.2017	03.01.2019	35 135 268	%	103.250	97.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 29.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.032%	GBP	1'000.00	03.01.2017	03.01.2019	34 443 791		-	98.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.01.2017	03.01.2019	35 135 269	%	103.350	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Inditex	EUR	1'000.00	03.07.2017	03.01.2019	37 046 749	%	88.050	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Telefonica Br	EUR	1'000.00	03.07.2017	03.01.2019	37 046 750	%	90.520	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	03.07.2017	03.01.2019	37 046 752	%	97.190	97.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 27.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.20%	USD	1'000.00	03.07.2017	03.01.2019	37 153 692		-	97.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ams I	CHF	57.19	03.10.2017	03.01.2019	38 310 181	CHF	59.700	100.000	100.000		0.000	Y
Capital Protection-Cert. on Euro Stoxx 50 Ind with ref bon	EUR	1'000.00	29.01.2014	07.01.2019	23 092 790	%	103.140	93.290	100.000	07.01.	8.047	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.01.2016	07.01.2019	29 347 886	%	99.170	95.940	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Telefonica	EUR	1'000.00	06.01.2017	07.01.2019	35 135 272	%	93.080	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	03.07.2017	07.01.2019	37 153 724		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.035%	USD	1'000.00	06.07.2017	07.01.2019	37 047 026		-	97.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.07.2017	07.01.2019	37 046 803	%	88.150	97.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	14.12.2016	09.01.2019	34 541 013		-	100.000	100.000		0.000	Y
Capital Protected-Cert. on Basket	EUR	1'000.00	22.10.2013	10.01.2019	22 406 502	%	94.400	93.980	100.000		0.000	Y
5 % Structured Note Credit Linked on RAIFFEISEN BANK INTERNAT AG	USD	1'000.00	22.02.2016	10.01.2019	31 524 343	%	105.020	100.000	100.000	10.01. 10.07.	25.764 24.170	N
6.62 % Structured Note Credit Linked on Vale SA	USD	1'000.00	22.02.2016	10.01.2019	31 524 342	%	104.070	100.000	100.000	10.01. 10.07.	33.366 32.001	N
Reverse Convertible on Frontier Comm	EUR	1'000.00	25.01.2017	10.01.2019	35 327 580	%	10.400	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 13.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.087%	USD	1'000.00	05.07.2017	10.01.2019	37 046 680		-	97.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	10.07.2017	10.01.2019	37 046 829		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	10.07.2017	10.01.2019	37 046 834		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.07.2017	10.01.2019	37 046 830	%	100.210	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	10.07.2017	10.01.2019	37 153 758	%	101.070	97.810	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	14.01.2014	14.01.2019	23 092 649	%	110.330	90.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 12.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.964%	EUR	1'000.00	13.01.2016	14.01.2019	29 347 891		-	99.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 15.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.573%	USD	1'000.00	17.01.2017	14.01.2019	34 902 216		-	97.220	100.000		0.000	Y
15 1/2 % (6.2 % p.a.) Reverse Convertible on Equities 12.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	15.07.2016	15.01.2019	32 829 620		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 15.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.904%	USD	1'000.00	10.07.2017	15.01.2019	37 046 831		-	97.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	17.01.2017	16.01.2019	35 135 344	%	86.520	97.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.979%	GBP	1'000.00	14.07.2017	17.01.2019	37 153 954		-	99.180	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 16.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.144%	USD	1'000.00	11.01.2017	18.01.2019	35 135 270		-	97.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.01.2017	18.01.2019	35 135 138	%	103.200	97.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.01.2017	21.01.2019	35 327 557	%	43.230	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	20.01.2017	21.01.2019	34 820 333	%	107.880	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.938%	USD	1'000.00	21.07.2017	21.01.2019	37 153 940		-	97.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.01.2017	22.01.2019	34 902 322	%	65.530	97.090	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	21.07.2017	22.01.2019	37 153 960	%	103.400	97.770	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.364%	USD	1'000.00	12.01.2017	23.01.2019	35 135 093		-	97.080	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.01.2017	23.01.2019	35 135 179	%	96.740	97.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.10.2017	23.01.2019	38 485 597	%	99.890	98.000	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Funds 23.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.232%	USD	1'000.00	24.01.2014	24.01.2019	23 092 799		-	91.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Peugeot 13.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	24.01.2017	24.01.2019	35 135 135		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 20.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.372%	USD	1'000.00	24.01.2017	24.01.2019	34 902 080		-	97.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.015%	USD	1'000.00	20.07.2017	24.01.2019	37 153 864		-	97.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 15.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.108%	USD	1'000.00	24.07.2017	24.01.2019	37 153 809		-	97.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.07.2017	24.01.2019	37 153 900	%	100.740	97.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.07.2017	24.01.2019	37 153 841	%	73.780	97.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 15.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.213%	USD	1'000.00	06.10.2017	24.01.2019	38 486 128		-	98.050	100.000		0.000	Y
9.4 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.01.2017	25.01.2019	35 135 296	%	104.150	100.000	100.000	21.07.	0.000	N
Reverse Convertible on Deutsche Bank N 20.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.935%	USD	1'000.00	25.01.2017	25.01.2019	35 327 584		-	97.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.256%	USD	1'000.00	25.01.2017	25.01.2019	35 135 469		-	97.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Macy's Rg	USD	1'000.00	25.01.2017	25.01.2019	35 327 583	%	96.470	97.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.249%	USD	1'000.00	26.01.2017	25.01.2019	35 327 841		-	97.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.021%	USD	1'000.00	25.07.2017	25.01.2019	37 421 010		-	97.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.07.2017	25.01.2019	37 153 839	%	99.300	97.750	100.000		0.000	Y
Callable Express Certificate on Indices 27.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.968%	GBP	1'000.00	28.01.2014	28.01.2019	23 092 821		-	90.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.07.2015	28.01.2019	28 781 872	%	90.350	95.180	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	28.01.2016	28.01.2019	29 348 238	%	94.690	97.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 21.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.265%	USD	1'000.00	28.07.2016	28.01.2019	32 829 490		-	97.590	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.01.2017	28.01.2019	35 327 835	%	31.940	96.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.909%	USD	1'000.00	28.07.2017	28.01.2019	37 153 941		-	97.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	28.07.2017	28.01.2019	37 420 869		-	100.000	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Funds 27.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.222%	USD	1'000.00	30.01.2014	30.01.2019	23 093 057		-	91.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	30.01.2015	30.01.2019	26 674 586	%	59.210	95.680	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 26.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	16.01.2017	30.01.2019	35 135 349		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.358%	USD	1'000.00	30.01.2017	30.01.2019	35 327 669		-	97.120	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on YPF SA Sp ADR-D 27.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.275%	USD	1'000.00	30.01.2017	30.01.2019	35 327 639		-	97.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ConocoPhillips Rg	USD	1'000.00	30.01.2017	30.01.2019	30 041 247	%	100.930	97.030	100.000		0.000	Y
14 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.10.2017	30.01.2019	38 486 206	%	99.540	100.000	100.000		0.000	N
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.10.2017	30.01.2019	38 486 112	%	100.810	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 27.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	19.01.2017	31.01.2019	35 135 426		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	31.01.2017	31.01.2019	35 448 045	%	91.730	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.07.2017	31.01.2019	37 420 871	%	91.740	97.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Ensco -A-	EUR	1'000.00	31.07.2017	31.01.2019	37 420 831	%	112.320	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Transocean N	EUR	1'000.00	31.07.2017	31.01.2019	37 420 830	%	113.540	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.998%	USD	1'000.00	31.07.2017	31.01.2019	37 420 896		-	97.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	01.02.2017	01.02.2019	35 327 730	%	100.510	97.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 29.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	01.02.2017	01.02.2019	35 327 855		-	97.050	100.000		0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.02.2017	01.02.2019	35 327 854	%	93.100	97.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.903%	USD	1'000.00	01.02.2017	01.02.2019	35 327 856		-	97.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	01.02.2017	01.02.2019	35 327 733	%	101.680	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	01.02.2017	01.02.2019	35 327 846	%	103.500	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.161%	USD	1'000.00	08.02.2017	01.02.2019	35 448 072		-	97.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.07.2017	01.02.2019	37 420 902	%	97.560	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	01.08.2017	01.02.2019	37 420 905	%	94.630	100.000	100.000		0.000	Y
108 % Barrier Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.08.2014	04.02.2019	24 565 120	%	85.570	97.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 2.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.896%	EUR	1'000.00	04.08.2015	04.02.2019	27 992 464		-	99.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 2.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.844%	USD	1'000.00	04.08.2015	04.02.2019	27 992 465		-	95.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 2.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.901%	EUR	1'000.00	04.08.2015	04.02.2019	27 992 463		-	99.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.08.2017	04.02.2019	37 643 915	%	95.500	100.000	100.000	09.08.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.004%	USD	1'000.00	04.08.2017	04.02.2019	37 420 943		-	97.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.02.2017	05.02.2019	35 327 842	%	104.520	97.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 5.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.379%	USD	50'000.00	01.02.2017	06.02.2019	35 135 416		-	97.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on CS Group N 2.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	06.02.2017	06.02.2019	35 327 865		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Banco Santander	EUR	1'000.00	06.02.2017	06.02.2019	35 327 640	%	110.570	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.811%	GBP	1'000.00	06.02.2017	06.02.2019	35 327 668		-	98.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.28%	USD	1'000.00	06.02.2017	06.02.2019	35 327 918		-	97.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.28%	USD	1'000.00	06.02.2017	06.02.2019	35 327 916		-	97.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Amazon.Com Rg 4.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.33%	USD	1'000.00	06.02.2017	06.02.2019	35 327 934		-	97.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.306%	USD	1'000.00	09.02.2017	06.02.2019	35 327 914		-	97.080	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.11.2017	06.02.2019	38 485 881	%	101.710	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.11.2017	06.02.2019	38 486 366	%	98.360	100.000	100.000		0.000	Y
CPC with Participation on Equities	USD	1'000.00	07.02.2014	07.02.2019	23 093 107	%	94.760	89.880	97.500		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	04.02.2015	07.02.2019	26 674 585	%	91.210	95.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.02.2017	07.02.2019	30 041 248	%	93.010	97.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.145%	USD	1'000.00	07.02.2017	07.02.2019	35 550 820		-	97.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.08.2017	07.02.2019	37 643 949	%	99.230	97.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.11.2017	07.02.2019	38 485 884	%	98.770	97.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.11.2017	07.02.2019	38 486 043	%	99.780	97.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.11.2017	08.02.2019	38 485 994	%	96.570	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on LafargeHolcim N	EUR	50.85	08.11.2017	08.02.2019	38 486 404	CHF	57.160	100.000	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	11.02.2014	11.02.2019	23 580 906	%	107.380	92.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	10.02.2017	11.02.2019	35 327 633		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on TevaPharmInd Sp ADR	USD	1'000.00	13.02.2017	11.02.2019	35 327 922	%	54.330	97.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.031%	USD	1'000.00	11.08.2017	11.02.2019	37 421 077		-	97.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.08.2017	11.02.2019	37 421 090	%	100.400	97.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.08.2017	11.02.2019	37 421 089	%	100.100	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.001%	USD	1'000.00	11.08.2017	11.02.2019	37 420 960		-	97.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	12.08.2015	12.02.2019	28 781 901	%	97.170	99.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	12.08.2015	13.02.2019	27 992 479	%	95.540	99.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 11.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.939%	USD	50'000.00	08.02.2017	13.02.2019	35 327 727		-	97.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.202%	USD	1'000.00	13.02.2017	13.02.2019	35 328 025		-	97.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	13.02.2017	13.02.2019	35 327 798		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Easyjet Rg	EUR	1'000.00	15.08.2017	15.02.2019	37 643 857	%	111.540	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities 17.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.457%	GBP	1'000.00	18.02.2014	18.02.2019	23 092 854		-	90.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	30.01.2017	18.02.2019	35 327 661		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.853%	USD	1'000.00	31.07.2017	18.02.2019	37 643 884		-	97.670	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Dt Lufthansa N	EUR	1'000.00	18.08.2017	18.02.2019	37 643 956	%	109.870	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	19.02.2013	19.02.2019	20 571 517	%	50.590	92.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	17.02.2017	19.02.2019	35 550 858	%	103.130	97.080	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.049%	USD	1'000.00	21.08.2017	21.02.2019	37 421 035		-	97.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.361%	SGD	1'000.00	21.08.2017	21.02.2019	37 644 063		-	98.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.213%	USD	1'000.00	22.02.2016	22.02.2019	30 040 890		-	97.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.23%	USD	1'000.00	22.02.2017	22.02.2019	35 447 841		-	96.990	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 20.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	18.08.2017	22.02.2019	37 644 000		-	100.000	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	25.02.2014	25.02.2019	23 092 751	%	3.620	94.580	100.000		0.000	N
Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	25.02.2014	25.02.2019	23 580 982	%	68.140	92.280	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	USD	1'000.00	25.02.2014	25.02.2019	23 093 106	%	92.060	92.460	100.000	24.08.	15.240	Y
Reverse Convertible on LANXESS 23.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	25.08.2016	25.02.2019	33 244 995		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.886%	USD	1'000.00	23.02.2017	25.02.2019	35 447 827		-	97.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Inditex	USD	1'000.00	25.08.2017	25.02.2019	37 749 505	%	87.350	97.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Total 25.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.294%	USD	1'000.00	27.02.2017	26.02.2019	35 447 817		-	97.050	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.02.2015	27.02.2019	26 674 847	%	49.170	99.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on US Steel Rg 27.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	01.02.2017	27.02.2019	35 448 059		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.201%	USD	1'000.00	27.02.2017	27.02.2019	35 447 902		-	96.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.02.2017	28.02.2019	35 550 936	%	101.030	97.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.08.2017	28.02.2019	37 644 026	%	99.400	97.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BP Rg 24.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	28.08.2017	28.02.2019	37 749 536		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Inditex	CHF	1'000.00	28.08.2017	28.02.2019	37 749 535	%	88.150	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.996%	USD	1'000.00	28.08.2017	28.02.2019	37 644 027		-	97.750	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	07.03.2014	01.03.2019	23 581 000	%	88.120	90.740	100.000		0.000	Y
4.6 % Reverse Convertible on Indices 25.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	01.09.2016	01.03.2019	33 245 089		-	100.000	100.000	27.02. 26.05. 25.08.	0.000 0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Equities 27.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.499%	USD	1'000.00	14.02.2017	01.03.2019	35 550 888		-	97.080	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.017%	USD	1'000.00	28.07.2017	01.03.2019	37 420 870		-	97.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Royal Dutch Shell-A	EUR	20.43	29.08.2017	01.03.2019	37 749 753	CHF	26.090	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.034%	USD	1'000.00	01.09.2017	01.03.2019	37 749 560		-	97.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	SEK	10'000.00	04.03.2015	04.03.2019	25 924 070	%	103.790	94.590	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on EDF 30.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	21.07.2016	04.03.2019	32 339 564		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Southwestern Energy	EUR	1'000.00	21.07.2016	04.03.2019	32 339 560	%	47.580	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Commodities	USD	1'000.00	24.08.2016	04.03.2019	33 244 855	%	93.110	97.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 2.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.242%	USD	1'000.00	27.02.2017	04.03.2019	35 447 913		-	96.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.169%	USD	1'000.00	27.02.2017	04.03.2019	35 447 892		-	96.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	02.03.2017	04.03.2019	35 550 912		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.881%	USD	1'000.00	02.03.2017	04.03.2019	35 447 987		-	97.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.03.2017	04.03.2019	35 447 986	%	100.440	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.08.2017	04.03.2019	37 643 965	%	97.070	97.720	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on BHP Billiton Rg	GBP	1'000.00	04.09.2017	04.03.2019	37 749 583	%	104.160	99.300	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	04.09.2017	04.03.2019	37 749 596	%	106.780	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on BAE Systems Rg	GBP	1'000.00	04.09.2017	04.03.2019	37 749 582	%	89.620	99.300	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities 1.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.504%	USD	1'000.00	05.03.2014	05.03.2019	23 581 084		-	92.370	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	05.03.2014	05.03.2019	23 092 897	%	17.890	92.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.11.2016	05.03.2019	34 080 878	%	30.560	97.580	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.08.2017	05.03.2019	37 749 585	%	90.900	97.770	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.025%	USD	1'000.00	31.08.2017	05.03.2019	37 749 584		-	97.770	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.025%	USD	1'000.00	31.08.2017	05.03.2019	37 749 586		-	97.770	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.09.2017	05.03.2019	37 749 726	%	108.130	97.810	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Equities 3.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.526%	USD	1'000.00	06.03.2014	06.03.2019	23 581 087		-	92.510	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	06.03.2014	06.03.2019	23 580 974	%	38.360	91.020	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 2.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.279%	USD	1'000.00	06.03.2017	06.03.2019	35 448 005		-	97.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.279%	USD	1'000.00	06.03.2017	06.03.2019	35 448 006		-	97.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.03.2017	06.03.2019	35 448 137	%	100.330	96.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.09.2017	07.03.2019	37 749 646	%	82.220	97.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.09.2017	08.03.2019	37 749 919	%	90.890	97.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	15.11.2017	08.03.2019	38 485 995	%	99.150	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	11.03.2015	11.03.2019	26 673 923	%	97.860	94.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.03.2015	11.03.2019	27 214 269	%	91.210	94.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	11.03.2016	11.03.2019	30 041 035		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on S&P GSCI Crd OilER	USD	1'000.00	11.03.2016	11.03.2019	31 524 413	%	22.870	96.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.102%	GBP	1'000.00	11.03.2016	11.03.2019	30 041 055		-	97.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 10.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.486%	USD	1'000.00	12.03.2015	12.03.2019	27 339 253		-	94.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.03.2017	13.03.2019	35 550 426	%	99.220	96.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.03.2017	13.03.2019	35 550 428	%	98.470	96.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.718%	USD	1'000.00	13.03.2017	13.03.2019	35 550 427		-	96.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.975%	USD	1'000.00	13.03.2017	13.03.2019	35 550 425		-	96.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 11.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.759%	USD	1'000.00	13.03.2017	13.03.2019	35 550 490		-	96.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.00%	USD	1'000.00	13.03.2017	13.03.2019	35 550 466		-	96.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.013%	USD	1'000.00	13.03.2017	13.03.2019	35 550 465		-	96.840	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Funds	USD	1'000.00	10.03.2016	14.03.2019	31 524 494	%	36.180	97.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.759%	USD	1'000.00	14.03.2017	14.03.2019	35 550 526		-	96.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.493%	USD	1'000.00	14.03.2017	14.03.2019	35 550 524		-	96.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	14.03.2017	14.03.2019	35 550 525		-	96.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.924%	USD	1'000.00	12.09.2017	14.03.2019	37 749 785		-	97.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.923%	USD	1'000.00	14.09.2017	14.03.2019	38 126 793		-	97.830	100.000	06.11.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.09.2017	14.03.2019	38 126 836	%	69.270	97.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	10.03.2016	15.03.2019	30 040 995		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	15.12.2017	15.03.2019	39 164 016	%	48.490	97.790	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	15.12.2017	15.03.2019	39 164 017	%	48.150	97.790	100.000		0.000	Y
4.61 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.03.2015	18.03.2019	27 214 291	%	80.360	95.660	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTXSD30 EUR P	EUR	1'000.00	18.03.2015	18.03.2019	26 673 956	%	103.040	99.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Caixabank 16.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	16.09.2016	18.03.2019	33 597 492		-	100.000	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	19.03.2014	19.03.2019	23 581 100	%	82.530	95.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.03.2017	20.03.2019	35 550 594	%	102.330	96.740	100.000		0.000	Y
Structured Note on Equities	USD	1'000.00	20.03.2017	20.03.2019	35 551 070	%	100.800	96.680	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	20.12.2017	20.03.2019	39 164 340	%	101.750	97.640	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Barrick Gold Rg 19.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.674%	USD	1'000.00	21.03.2017	21.03.2019	35 550 690		-	96.700	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Basket 12.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	21.03.2017	21.03.2019	35 550 514		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Banco Santander Rg 20.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.967% 20.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	22.03.2017	22.03.2019	35 550 689		-	96.680	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BBVA Rg 20.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.967% 20.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	22.03.2017	22.03.2019	35 550 688		-	96.680	100.000		0.000	Y
Uncapped Capital Protection on SMI Index	CHF	1'000.00	25.03.2011	25.03.2019	12 307 050	%	122.420	85.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	25.09.2014	25.03.2019	25 444 927	%	86.490	92.200	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Apple	USD	1'000.00	18.03.2016	25.03.2019	30 041 101	%	141.440	96.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.03.2017	25.03.2019	35 914 146	%	103.970	96.730	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.03.2017	25.03.2019	35 914 147	%	89.300	96.730	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.09.2017	26.03.2019	38 126 619	%	90.580	97.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.09.2017	26.03.2019	38 126 882	%	98.370	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.03.2017	27.03.2019	35 550 730	%	96.700	96.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.03.2017	27.03.2019	35 550 729	%	96.080	96.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 30.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.881%	USD	1'000.00	23.03.2017	28.03.2019	35 550 963		-	96.700	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.114%	USD	1'000.00	28.03.2017	28.03.2019	35 550 781		-	96.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.03.2017	28.03.2019	35 550 782	%	97.280	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	28.03.2017	28.03.2019	35 550 783		-	96.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.09.2017	28.03.2019	38 126 962	%	90.780	97.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.09.2017	28.03.2019	30 041 345	%	100.050	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 23.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.088%	USD	1'000.00	31.03.2017	29.03.2019	35 550 743		-	96.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 29.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.057%	USD	1'000.00	26.09.2017	29.03.2019	30 041 338		-	97.790	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	USD	1'000.00	11.04.2013	01.04.2019	20 802 438	%	98.650	93.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.789%	USD	1'000.00	31.03.2017	01.04.2019	35 914 311		-	96.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on TevaPharmInd Sp ADR	EUR	1'000.00	31.08.2017	01.04.2019	37 749 889	%	49.430	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	02.10.2017	02.04.2019	38 309 939	%	92.630	97.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 29.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.024%	USD	1'000.00	02.10.2017	02.04.2019	38 309 952		-	97.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.10.2017	02.04.2019	38 309 950	%	98.510	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on EFG/NC Fund Stars Strategy 2	USD	10'000.00	28.04.2015	03.04.2019	26 674 806	%	101.520	95.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Bank of America Rg 4.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.606%	USD	1'000.00	27.03.2017	03.04.2019	30 041 270		-	96.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.10.2017	03.04.2019	38 310 012	%	94.310	97.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 3.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.739%	USD	1'000.00	04.04.2016	04.04.2019	31 524 486		-	96.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.888%	USD	1'000.00	04.04.2016	04.04.2019	31 524 495		-	96.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 7.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.943%	USD	1'000.00	30.03.2017	04.04.2019	35 550 967		-	96.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.10.2017	04.04.2019	38 310 021	%	102.240	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.916%	USD	1'000.00	05.10.2017	04.04.2019	38 126 754		-	97.740	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.04.2017	05.04.2019	36 171 060	%	51.920	96.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.10.2017	05.04.2019	38 310 040	%	98.270	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
0 % Reverse Convertible on Gold 1 Uz	USD	1'000.00	05.10.2017	05.04.2019	38 486 118	%	99.180	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on iShs MSCI Em Mk 6.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.709%	USD	1'000.00	08.04.2016	08.04.2019	31 524 586		-	97.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 5.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	12.04.2016	08.04.2019	31 524 613		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	09.10.2017	09.04.2019	38 310 232	%	99.500	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.10.2017	10.04.2019	38 310 217	%	76.700	97.580	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.10.2017	10.04.2019	38 310 246	%	97.100	97.590	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	11.04.2014	11.04.2019	23 581 190	%	84.200	90.350	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	11.04.2014	11.04.2019	23 581 202	%	93.750	95.150	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.04.2016	11.04.2019	31 524 610	%	34.200	97.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	21.03.2017	11.04.2019	35 550 639	%	102.530	96.590	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.56%	USD	1'000.00	07.04.2017	11.04.2019	35 914 344		-	96.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.10.2017	11.04.2019	38 310 298	%	91.710	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	12.10.2016	12.04.2019	33 597 710	%	70.220	97.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.10.2017	12.04.2019	38 310 218	%	97.020	97.620	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	USD	1'000.00	15.04.2014	15.04.2019	23 581 225	%	100.570	91.600	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	29.04.2014	15.04.2019	23 581 285	%	57.040	91.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	15.04.2015	15.04.2019	26 674 065	%	115.830	99.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Repsol	EUR	1'000.00	15.04.2015	15.04.2019	26 674 064	%	113.210	99.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Telefonica	EUR	1'000.00	15.04.2015	15.04.2019	26 674 063	%	63.650	99.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	15.10.2015	15.04.2019	29 348 089	%	81.590	95.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	15.04.2016	15.04.2019	31 185 478		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.10.2017	15.04.2019	38 310 272	%	95.730	97.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.10.2017	15.04.2019	38 310 337	%	86.630	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.04.2015	16.04.2019	27 339 584	%	46.570	94.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.04.2015	16.04.2019	27 339 585	%	47.340	94.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.556%	USD	1'000.00	11.04.2017	16.04.2019	36 170 821		-	96.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on VanEck Gold Miners	USD	1'000.00	11.10.2017	16.04.2019	38 310 307	%	99.050	97.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.10.2017	16.04.2019	38 486 140	%	92.750	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.10.2017	16.04.2019	38 310 245	%	83.710	97.590	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.10.2017	17.04.2019	38 310 405	%	98.590	97.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.10.2017	17.04.2019	38 310 403	%	86.780	97.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.10.2017	17.04.2019	38 310 401	%	65.640	97.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.574%	GBP	1'000.00	18.04.2016	18.04.2019	31 185 442		-	97.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.10.2016	18.04.2019	33 851 178	%	38.530	97.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.10.2017	19.04.2019	38 310 373	%	96.480	97.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.04.2015	22.04.2019	26 674 134	%	81.460	95.080	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.10.2017	22.04.2019	38 310 406	%	100.160	97.520	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	15.04.2014	23.04.2019	23 580 922	%	96.690	95.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.10.2015	23.04.2019	29 348 096	%	84.780	96.410	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.10.2017	23.04.2019	38 485 538	%	100.430	97.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.10.2017	23.04.2019	38 486 139	%	94.540	97.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on AIR France - KLM P 21.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.82%	USD	1'000.00	23.10.2017	23.04.2019	38 485 607		-	97.560	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	25.04.2014	25.04.2019	23 581 141	%	77.860	91.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.10.2017	25.04.2019	38 485 539	%	92.860	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.10.2017	25.04.2019	38 485 540	%	94.640	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.10.2017	25.04.2019	38 485 568	%	95.540	97.500	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.10.2017	25.04.2019	38 310 287	%	85.940	97.590	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.10.2017	25.04.2019	38 485 614	%	99.900	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.10.2017	25.04.2019	38 485 612	%	95.870	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.10.2017	25.04.2019	38 310 288	%	98.160	97.590	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	26.04.2017	26.04.2019	36 170 879		-	96.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 22.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.801%	USD	1'000.00	26.04.2017	26.04.2019	36 170 905		-	97.090	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.10.2017	26.04.2019	38 485 640	%	99.050	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.04.2015	30.04.2019	26 674 236	%	89.600	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.05.2015	30.04.2019	25 932 590	%	50.480	96.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	06.05.2016	30.04.2019	31 524 677	%	40.290	97.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.04.2017	30.04.2019	36 171 310	%	98.050	100.000	100.000	26.10.		Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.10.2017	30.04.2019	38 485 703	%	93.410	97.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on YPF SA Sp ADR-D	USD	1'000.00	01.05.2017	01.05.2019	36 170 962	%	92.920	96.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.11.2017	01.05.2019	38 486 255	%	101.340	97.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.11.2017	02.05.2019	38 485 962	%	98.700	97.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.11.2017	02.05.2019	38 485 947	%	97.650	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	02.11.2017	02.05.2019	38 485 951	%	97.480	97.500	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.05.2016	03.05.2019	31 524 504	%	102.110	96.800	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	03.05.2016	03.05.2019	31 185 554	%	111.040	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.765%	USD	1'000.00	03.05.2017	03.05.2019	36 171 338		-	96.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.10.2017	03.05.2019	38 310 025	%	99.330	97.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.10.2017	03.05.2019	38 310 016	%	98.820	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.10.2017	03.05.2019	38 485 759	%	100.170	97.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.05.2016	06.05.2019	31 524 443	%	14.190	97.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	06.05.2016	06.05.2019	31 524 673		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.777%	USD	1'000.00	01.05.2017	06.05.2019	36 170 925		-	97.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.065%	USD	1'000.00	04.05.2017	06.05.2019	36 171 481		-	96.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.05.2015	07.05.2019	27 339 360	%	82.730	99.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	07.05.2015	07.05.2019	26 674 274	%	96.620	94.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.05.2015	07.05.2019	26 674 287	%	87.730	94.700	100.000		0.000	Y
8.2 % Reverse Convertible on Equities 31.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.11.2016	07.05.2019	34 080 812		-	100.000	100.000	02.05. 31.10.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.05.2017	07.05.2019	36 170 942	%	92.560	97.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 5.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.589%	USD	1'000.00	07.11.2017	07.05.2019	38 486 390		-	97.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	SGD	1'000.00	13.05.2015	08.05.2019	27 339 641	%	103.070	93.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.11.2017	08.05.2019	38 485 649	%	95.790	97.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.11.2017	08.05.2019	38 485 868	%	92.360	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.166%	GBP	1'000.00	09.05.2016	09.05.2019	31 524 680		-	97.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.11.2017	09.05.2019	38 485 860	%	97.640	97.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	09.11.2017	09.05.2019	38 486 026	%	98.420	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.05.2017	10.05.2019	36 171 326	%	97.750	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	10.11.2017	10.05.2019	38 486 044	%	96.600	97.460	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Indices	EUR	1'000.00	13.05.2014	13.05.2019	24 205 637	%	93.010	94.580	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.05.2015	13.05.2019	26 674 339	%	89.970	94.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Altice A	USD	1'000.00	13.11.2017	13.05.2019	38 486 068	%	76.400	97.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.11.2017	13.05.2019	38 485 910	%	99.110	97.490	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	14.05.2014	14.05.2019	23 093 003	%	91.460	95.520	100.000	14.11.	10.724	Y
Bonus Certificate on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	14.05.2014	14.05.2019	24 205 563	%	107.490	95.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.11.2017	14.05.2019	38 486 089	%	101.350	97.460	100.000		0.000	Y
8 % (5.33 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.11.2017	14.05.2019	38 486 429	%	103.930	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.05.2017	15.05.2019	36 171 357	%	93.560	96.880	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	19.07.2017	15.05.2019	37 153 844	%	99.620	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.11.2017	15.05.2019	38 485 804	%	98.200	97.450	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Funds	EUR	1'000.00	16.05.2014	16.05.2019	24 205 661	%	106.320	95.520	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Funds	USD	1'000.00	16.05.2014	16.05.2019	24 205 660	%	107.110	91.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 16.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.85%	USD	1'000.00	21.04.2017	16.05.2019	36 170 881		-	96.890	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Currencies	USD	1'000.00	16.05.2017	16.05.2019	36 171 561	%	97.330	96.840	100.000		0.000	Y
15.00 % (6.00 % p.a.) Reverse Convertible on Equities 15.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	17.11.2016	17.05.2019	34 443 643		-	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	14.11.2017	17.05.2019	39 034 356	%	99.840	97.400	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Funds	USD	1'000.00	20.05.2014	20.05.2019	23 093 032	%	78.270	91.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	19.05.2016	20.05.2019	32 339 423	%	28.050	97.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	20.05.2016	20.05.2019	31 524 462	%	86.910	97.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.27%	USD	1'000.00	02.11.2016	20.05.2019	34 080 485		-	97.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 16.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.886%	USD	1'000.00	18.11.2016	20.05.2019	34 540 768		-	96.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.05.2017	20.05.2019	36 171 603	%	92.950	96.870	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	1'000.00	11.07.2017	20.05.2019	37 046 774	%	97.200	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.11.2017	20.05.2019	38 485 798	%	101.410	97.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	20.05.2019	38 486 469	%	98.570	97.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.457%	USD	1'000.00	28.11.2017	20.05.2019	39 164 185		-	97.360	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.05.2017	21.05.2019	36 171 375	%	100.220	96.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.52%	USD	1'000.00	16.05.2017	21.05.2019	36 171 376		-	96.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.11.2017	21.05.2019	38 485 886	%	96.840	100.000	100.000		0.000	Y
Callable Express Certificate on Indices	EUR	1'000.00	22.05.2014	22.05.2019	23 093 038	%	100.450	96.330	100.000	21.08. 21.11.	8.511 8.726	Y
Reverse Convertible on Equities 21.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.045%	USD	1'000.00	22.05.2015	22.05.2019	27 992 801		-	94.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Bouygues	EUR	1'000.00	22.05.2017	22.05.2019	36 171 411	%	104.350	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	22.11.2017	22.05.2019	38 486 519	%	99.880	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.04.2017	23.05.2019	35 550 717	%	97.850	96.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.05.2017	23.05.2019	36 171 415	%	93.960	96.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	22.05.2017	23.05.2019	36 171 416	%	94.630	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	23.05.2019	38 486 471	%	101.010	97.390	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.11.2017	24.05.2019	39 034 386	%	98.880	97.390	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	12.05.2015	27.05.2019	27 339 513	%	97.390	98.960	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	28.05.2014	28.05.2019	24 205 705	%	20.350	95.710	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	11.06.2014	29.05.2019	23 581 338	%	89.260	90.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 24.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.64%	EUR	1'000.00	29.05.2015	29.05.2019	27 992 047		-	98.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.883%	USD	1'000.00	30.05.2017	30.05.2019	36 171 495		-	97.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.05.2017	30.05.2019	36 171 753	%	94.860	97.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.622%	USD	1'000.00	30.05.2017	30.05.2019	36 786 316		-	96.990	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	30.05.2017	30.05.2019	36 786 136	%	99.650	98.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Unilever Cert	EUR	42.67	30.10.2017	30.05.2019	38 486 320	CHF	49.380	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.05.2017	31.05.2019	36 171 496	%	100.040	97.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.11.2017	31.05.2019	39 034 503	%	101.580	97.310	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	03.06.2014	03.06.2019	24 205 708	%	72.200	90.350	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities 1.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.801%	EUR	1'000.00	10.06.2014	03.06.2019	24 205 756		-	96.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 29.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.201%	USD	1'000.00	03.06.2015	03.06.2019	27 992 817		-	94.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.11.2017	03.06.2019	38 486 256	%	98.870	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.11.2017	03.06.2019	39 034 446	%	96.860	97.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.446%	USD	1'000.00	04.12.2017	03.06.2019	39 034 506		-	97.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 1.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.299%	GBP	1'000.00	04.06.2015	04.06.2019	27 992 048		-	94.590	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Total	USD	1'000.00	05.06.2017	04.06.2019	36 786 147	%	93.660	97.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.12.2017	04.06.2019	39 034 568	%	99.750	97.330	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	04.12.2017	04.06.2019	39 034 473	%	99.960	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Caixabank 1.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	05.12.2016	05.06.2019	34 540 643		-	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.10.2017	05.06.2019	38 485 665	%	97.530	97.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.868%	USD	1'000.00	06.06.2016	06.06.2019	32 339 466		-	96.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.06.2016	06.06.2019	32 339 464	%	96.500	96.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Deutsche Bank N 2.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.135%	USD	1'000.00	06.06.2016	06.06.2019	31 185 702		-	96.660	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	06.06.2017	06.06.2019	36 786 457	%	99.980	97.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 4.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	06.06.2017	06.06.2019	36 171 734		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	07.06.2017	07.06.2019	36 786 452	%	100.130	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.12.2017	07.06.2019	39 034 566	%	100.710	97.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.12.2017	07.06.2019	39 034 564	%	100.020	97.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.12.2017	07.06.2019	39 034 567	%	102.590	97.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.12.2017	07.06.2019	39 034 565	%	98.760	97.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.12.2017	07.06.2019	39 164 188	%	100.330	97.290	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	10.06.2014	10.06.2019	24 205 857	%	80.800	92.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on UBI Banca 8.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	10.06.2016	10.06.2019	31 185 747		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.88%	USD	1'000.00	05.06.2017	10.06.2019	36 786 213		-	97.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.88%	USD	1'000.00	05.06.2017	10.06.2019	36 786 214		-	97.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.06.2017	10.06.2019	36 786 496	%	80.370	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Xilinx Rg	EUR	1'000.00	10.10.2017	10.06.2019	38 310 306	%	94.510	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.869%	USD	1'000.00	12.06.2017	12.06.2019	36 786 492		-	97.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	SGD	1'000.00	12.06.2017	12.06.2019	36 171 501	%	97.010	97.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.06.2017	12.06.2019	36 171 498	%	98.890	97.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.12.2017	12.06.2019	39 034 539	%	94.190	97.390	100.000		0.000	Y
Express Certificate on REPSOL	EUR	1'000.00	13.06.2014	13.06.2019	23 581 379	%	80.380	96.620	100.000	12.12.	8.033	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.12.2017	13.06.2019	39 164 056	%	97.630	97.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Bouygues 12.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	10.06.2016	14.06.2019	32 339 592		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Credit Agricole	EUR	1'000.00	14.06.2016	14.06.2019	32 339 593	%	132.960	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 11.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.196%	NOK	1'000.00	13.06.2017	14.06.2019	36 786 382		-	97.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	14.06.2019	38 486 468	%	93.870	97.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Peugeot	EUR	1'000.00	14.12.2017	14.06.2019	39 164 066	%	99.450	100.000	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	17.06.2014	17.06.2019	24 564 750	%	90.910	91.690	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	17.06.2014	17.06.2019	24 564 749	%	102.760	91.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.06.2015	17.06.2019	28 370 828	%	99.180	93.880	100.000	14.12.	27.029	Y
Reverse Convertible on Sprint-1 20.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	13.01.2017	17.06.2019	35 135 084		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.608%	USD	1'000.00	16.06.2017	17.06.2019	37 046 920		-	97.040	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices 16.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.251%	GBP	1'000.00	25.06.2014	18.06.2019	24 564 763		-	90.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	29.11.2017	18.06.2019	39 034 499	%	96.130	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.12.2016	19.06.2019	34 765 681	%	91.110	96.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.06.2017	19.06.2019	36 786 429	%	98.460	97.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.06.2017	19.06.2019	37 046 973	%	96.990	97.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.06.2017	19.06.2019	36 786 546	%	94.330	97.050	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Roche Hldg G	CHF	1'000.00	19.06.2017	19.06.2019	36 786 532	%	95.370	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 15.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.844%	USD	1'000.00	19.06.2017	19.06.2019	36 786 581		-	97.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.06.2017	19.06.2019	36 786 543	%	89.890	97.050	100.000		0.000	N
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	20.06.2014	20.06.2019	24 205 678	%	90.030	90.130	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	20.06.2014	20.06.2019	24 205 679	%	34.610	90.130	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Biogen	USD	1'000.00	20.06.2016	20.06.2019	32 339 611	%	121.530	97.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 16.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	20.06.2016	20.06.2019	32 339 608		-	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 16.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	20.06.2016	20.06.2019	32 339 606		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on TevaPharmInd Sp ADR	USD	1'000.00	20.06.2016	20.06.2019	30 041 220	%	39.150	97.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on UBI Banca 16.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	20.06.2016	20.06.2019	31 524 293		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 21.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.799%	USD	1'000.00	22.05.2017	20.06.2019	36 171 407		-	96.800	100.000		0.000	Y
13.75 % (5.51 % p.a.) Reverse Convertible on Equities 22.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	22.12.2016	21.06.2019	34 765 836		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	21.06.2017	21.06.2019	36 786 621		-	100.000	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Dt.Lufthansa N 23.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.724%	EUR	1'000.00	24.06.2014	24.06.2019	24 204 887		-	96.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	24.06.2016	24.06.2019	32 339 457	%	79.210	97.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.12.2017	24.06.2019	39 164 112	%	95.150	97.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.06.2015	26.06.2019	26 674 377	%	86.330	98.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Macy's Rg 22.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	19.06.2017	26.06.2019	36 786 575		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Vipshop Hldg Sp ADR	EUR	1'000.00	19.06.2017	26.06.2019	36 786 577	%	92.590	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ArcelorMittal Rg 22.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	19.06.2017	26.06.2019	36 786 574		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Cemex Sp ADR	EUR	1'000.00	19.06.2017	26.06.2019	36 786 578	%	89.420	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Micron Technolog Rg 22.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	19.06.2017	26.06.2019	36 786 576		-	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	USD	1'000.00	27.06.2013	27.06.2019	21 385 651	%	115.990	89.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.06.2017	27.06.2019	37 046 687	%	98.070	96.990	100.000		0.000	Y
10.05 % (6.7 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.12.2017	27.06.2019	39 164 311	%	98.920	100.000	100.000		0.000	Y
12 % (8 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.12.2017	27.06.2019	39 164 310	%	97.970	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	28.12.2015	28.06.2019	30 497 804	%	125.090	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	20.06.2014	01.07.2019	24 564 771	%	68.620	96.460	100.000	29.09.	8.235	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	26.06.2017	01.07.2019	37 046 657	%	101.280	97.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 29.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.864%	USD	1'000.00	29.06.2017	01.07.2019	37 153 681		-	97.020	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	02.07.2014	02.07.2019	24 564 868	%	95.000	91.690	100.000		0.000	Y
Contingent Capital Protected-Cert. on Basket	EUR	1'000.00	25.04.2014	03.07.2019	24 205 525	%	95.660	88.780	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	USD	1'000.00	03.07.2014	03.07.2019	24 564 743	%	99.160	91.920	100.000		0.000	Y
Capital Protected-Cert. on EURO STOXX SelectDiv30 Cr Lkd	USD	1'000.00	07.08.2014	03.07.2019	24 565 204	%	99.880	88.750	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	13.05.2015	03.07.2019	26 674 355	%	96.960	98.770	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	20.05.2015	03.07.2019	26 674 427	%	97.900	98.770	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	03.07.2015	03.07.2019	27 992 918	%	99.030	93.770	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.992%	GBP	1'000.00	03.07.2015	03.07.2019	27 992 915		-	93.770	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTXBnk EUR P 30.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	03.01.2017	03.07.2019	34 902 009		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	03.01.2017	03.07.2019	35 135 257	%	80.850	96.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Vale Sp ADR 28.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.379%	USD	1'000.00	03.07.2017	03.07.2019	37 046 735		-	97.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.07.2017	03.07.2019	37 047 032	%	84.560	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.07.2017	03.07.2019	37 046 765	%	103.790	97.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.07.2017	03.07.2019	37 046 753	%	103.530	97.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CAD	1'000.00	26.06.2017	04.07.2019	37 153 630	%	40.190	97.470	100.000		0.000	Y
Floored Floater Credit Linked on National Australia Bank Limited	USD	1'000.00	04.04.2014	05.07.2019	23 581 219	%	95.920	100.000	100.000	20.03. 20.06. 20.09. 20.12.	4.983 4.988 4.915 4.978	N
Reverse Convertible on Equities 2.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	05.07.2016	05.07.2019	32 339 344		-	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 2.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	05.07.2016	05.07.2019	31 524 743		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on S&P GSCI Crd OilER 3.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.293%	USD	1'000.00	05.07.2016	05.07.2019	32 829 545		-	97.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.07.2017	05.07.2019	37 046 734	%	102.020	97.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.07.2017	05.07.2019	37 046 732	%	101.270	97.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.07.2017	05.07.2019	37 046 733	%	101.350	97.020	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Currencies	USD	1'000.00	05.07.2017	05.07.2019	37 153 749	%	98.080	96.700	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.07.2017	05.07.2019	37 046 773	%	73.000	96.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.07.2017	05.07.2019	37 046 777	%	103.290	96.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.07.2017	05.07.2019	37 046 772	%	101.280	97.010	100.000		0.000	Y
Outperformance Certificate on Zurich Insur GrpN	USD	1'000.00	07.07.2014	08.07.2019	24 564 927	%	123.760	91.910	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	08.07.2014	08.07.2019	24 204 902	%	59.350	96.670	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices 7.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.526%	GBP	1'000.00	08.07.2014	08.07.2019	24 564 851		-	89.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 5.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	08.07.2016	08.07.2019	32 339 358		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 5.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	08.07.2016	08.07.2019	32 339 367		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Total 5.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	08.07.2016	08.07.2019	32 339 357		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.07.2017	09.07.2019	37 046 767	%	100.770	97.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.07.2015	10.07.2019	27 992 299	%	87.400	98.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.255%	USD	1'000.00	10.07.2017	10.07.2019	37 046 825		-	96.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.07.2017	10.07.2019	37 046 826	%	101.050	96.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on SPDR S&P OilGs ExPr 3.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.086%	USD	1'000.00	10.07.2017	10.07.2019	37 153 751		-	96.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.07.2017	10.07.2019	36 171 515	%	102.320	96.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.07.2017	10.07.2019	37 046 823	%	100.550	96.910	100.000		0.000	Y
Outperformance Certificate on Zurich Insur GrpN	USD	1'000.00	04.08.2014	11.07.2019	24 565 194	%	120.210	91.660	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	15.07.2014	15.07.2019	24 565 021	%	78.450	96.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	15.07.2015	15.07.2019	27 992 320	%	102.710	98.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	15.07.2015	15.07.2019	27 992 298	%	99.460	98.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	15.05.2017	15.07.2019	36 171 343	%	105.850	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	16.07.2014	16.07.2019	24 564 937	%	79.330	89.780	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	16.07.2014	16.07.2019	24 565 070	%	107.840	91.560	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	24.07.2014	17.07.2019	24 565 018	%	16.630	89.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Gerdau Sp.ADR Pfd	EUR	1'000.00	17.07.2015	17.07.2019	28 781 809	%	10.290	98.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.469%	USD	1'000.00	19.06.2017	17.07.2019	36 786 571		-	96.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.07.2017	17.07.2019	37 153 770	%	102.170	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 13.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.015%	USD	1'000.00	17.07.2017	17.07.2019	37 153 793		-	96.800	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities 6.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	18.07.2014	18.07.2019	24 204 928		-	96.670	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Commodities	USD	1'000.00	08.07.2014	19.07.2019	24 564 929	%	54.110	91.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	100.00	26.07.2016	19.07.2019	32 829 367	%	48.110	97.360	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	19.01.2017	19.07.2019	35 327 560	%	113.300	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.07.2017	19.07.2019	37 153 859	%	102.150	96.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	GBP	1'000.00	19.07.2017	19.07.2019	37 420 970	%	96.510	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	22.07.2016	22.07.2019	32 829 625		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 20.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.589%	USD	1'000.00	22.07.2016	22.07.2019	32 339 576		-	97.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.006%	USD	1'000.00	21.07.2017	22.07.2019	37 153 952		-	96.810	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.07.2017	22.07.2019	37 153 951	%	101.620	96.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.07.2017	22.07.2019	37 153 950	%	100.410	96.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.07.2017	22.07.2019	37 153 847	%	95.940	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.07.2017	22.07.2019	37 153 846	%	93.890	100.000	100.000	19.10.	18.503	Y
Express-Cert. on Equities	USD	1'000.00	23.07.2014	23.07.2019	24 204 968	%	99.130	91.510	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	23.01.2017	23.07.2019	35 135 248	%	112.270	100.000	100.000		0.000	Y
Express Certificate on REPSOL	EUR	1'000.00	24.07.2014	24.07.2019	24 204 951	%	81.810	96.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.07.2017	24.07.2019	37 153 907	%	101.400	96.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.07.2017	25.07.2019	37 153 975	%	92.370	96.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 23.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.145%	USD	1'000.00	25.07.2017	25.07.2019	37 154 001		-	96.930	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	23.01.2017	26.07.2019	35 135 369	%	104.070	96.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Easyjet Rg 24.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	26.01.2017	26.07.2019	35 327 609		-	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices 28.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.742%	EUR	1'000.00	29.07.2014	29.07.2019	24 204 981		-	96.910	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	04.08.2014	29.07.2019	24 565 123	%	98.280	90.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ConocoPhillips Rg	USD	1'000.00	24.07.2017	29.07.2019	37 153 885	%	100.790	96.850	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	30.07.2014	30.07.2019	24 565 077	%	76.110	91.690	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	30.07.2014	30.07.2019	24 204 939	%	95.390	96.860	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices 28.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.555%	GBP	1'000.00	31.07.2014	31.07.2019	24 565 101		-	89.870	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	07.08.2014	31.07.2019	24 565 198	%	93.870	91.580	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices 28.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	07.08.2014	31.07.2019	24 565 093		-	96.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.662%	GBP	1'000.00	31.07.2015	31.07.2019	28 781 881		-	93.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.07.2017	31.07.2019	37 420 898	%	83.030	96.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.07.2017	31.07.2019	37 420 899	%	99.530	96.890	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	01.08.2014	01.08.2019	24 565 106	%	73.250	91.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Easyjet 31.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	26.01.2017	02.08.2019	35 135 190		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 30.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.229%	USD	1'000.00	27.07.2017	02.08.2019	37 420 985		-	96.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	02.08.2017	02.08.2019	37 420 925	%	92.890	96.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.08.2017	02.08.2019	37 643 919	%	99.730	97.480	100.650		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	03.08.2016	05.08.2019	33 244 718	%	93.480	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.341%	USD	1'000.00	05.08.2016	05.08.2019	30 041 229		-	97.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.341%	USD	1'000.00	05.08.2016	05.08.2019	30 041 228		-	97.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.11.2017	05.08.2019	38 500 353	%	94.700	96.900	100.000		0.000	Y
Certificate on Basket	GBP	1'000.00	08.08.2014	06.08.2019	24 564 751	%	95.450	90.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	06.02.2017	06.08.2019	35 327 919		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.08.2015	07.08.2019	28 370 933	%	73.820	98.420	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	USD	1'000.00	07.08.2015	07.08.2019	28 370 992	%	112.140	94.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.08.2017	07.08.2019	37 421 047	%	93.870	96.910	100.000		0.000	Y
Multi Barrier Reverse Convertible on basket	EUR	1'000.00	08.08.2014	08.08.2019	24 565 125	%	79.120	96.960	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	08.08.2014	08.08.2019	24 564 792	%	92.410	96.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 6.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	08.08.2017	08.08.2019	37 421 056		-	96.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.08.2017	08.08.2019	37 421 059	%	91.890	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 5.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.47%	GBP	1'000.00	09.08.2016	09.08.2019	33 244 981		-	98.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 5.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.439%	GBP	1'000.00	09.08.2016	09.08.2019	33 244 980		-	98.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 5.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.439%	GBP	1'000.00	09.08.2016	09.08.2019	33 244 979		-	98.460	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Basket 5.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.439%	GBP	1'000.00	09.08.2016	09.08.2019	33 244 978		-	98.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 5.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.439%	GBP	1'000.00	09.08.2016	09.08.2019	33 244 977		-	98.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 5.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.439%	GBP	1'000.00	09.08.2016	09.08.2019	33 244 976		-	98.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 5.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.439%	GBP	1'000.00	09.08.2016	09.08.2019	33 244 975		-	98.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 5.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.439%	GBP	1'000.00	09.08.2016	09.08.2019	33 244 974		-	98.460	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	09.08.2016	09.08.2019	33 244 971	%	92.110	92.320	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.08.2016	09.08.2019	33 244 961	%	95.160	96.290	99.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.127%	USD	1'000.00	09.08.2017	09.08.2019	37 421 048		-	96.910	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	12.08.2014	12.08.2019	24 565 169	%	87.690	90.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	12.08.2015	12.08.2019	28 781 925	%	111.710	98.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 9.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	12.08.2016	12.08.2019	33 244 761		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.288%	USD	1'000.00	12.08.2016	12.08.2019	33 244 799		-	97.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.288%	USD	1'000.00	12.08.2016	12.08.2019	32 829 658		-	97.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.08.2016	12.08.2019	33 245 077	%	14.830	97.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 10.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	12.08.2016	12.08.2019	33 245 081		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 9.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.239%	USD	1'000.00	12.08.2016	12.08.2019	33 244 764		-	97.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.08.2017	12.08.2019	37 643 917	%	92.210	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities 11.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.741%	EUR	1'000.00	13.08.2014	13.08.2019	24 565 195		-	96.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 11.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.335%	USD	1'000.00	13.02.2017	13.08.2019	34 443 805		-	96.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.02.2017	13.08.2019	35 550 867	%	51.890	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.08.2017	14.08.2019	37 643 828	%	98.260	96.930	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	14.08.2017	14.08.2019	37 644 106	%	97.770	96.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 15.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.189%	USD	1'000.00	08.08.2017	15.08.2019	36 171 298		-	96.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	14.08.2017	15.08.2019	37 421 064		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.08.2017	15.08.2019	37 153 977	%	93.350	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.08.2017	15.08.2019	37 644 124	%	99.630	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.08.2016	16.08.2019	33 597 413	%	44.860	96.920	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	18.08.2017	16.08.2019	37 749 504	%	98.040	96.860	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	USD	1'000.00	19.08.2014	19.08.2019	24 565 280	%	107.440	91.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.08.2015	19.08.2019	28 781 997	%	131.070	94.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Micron Technology 17.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.751%	USD	1'000.00	17.08.2016	19.08.2019	33 245 071		-	97.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.08.2016	19.08.2019	33 245 072	%	19.470	97.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.96%	USD	1'000.00	10.08.2017	19.08.2019	37 644 094		-	96.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Banco Santander Rg	EUR	1'000.00	14.08.2017	19.08.2019	37 643 832	%	96.120	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.08.2017	19.08.2019	37 643 957	%	103.700	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	AUD	1'000.00	20.02.2017	20.08.2019	35 327 764	%	100.230	94.660	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	22.08.2014	22.08.2019	24 565 334	%	79.750	91.650	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 14.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.83%	USD	1'000.00	23.08.2016	23.08.2019	33 244 845		-	96.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 19.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	23.02.2017	23.08.2019	35 447 900		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.912%	USD	1'000.00	25.07.2017	23.08.2019	37 153 994		-	96.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	23.08.2017	23.08.2019	30 041 322	%	100.560	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.156%	USD	1'000.00	27.02.2017	27.08.2019	35 327 774		-	95.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	28.08.2015	28.08.2019	28 781 854	%	112.610	94.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.08.2015	28.08.2019	28 781 855	%	114.720	94.670	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.02.2017	28.08.2019	35 551 004	%	98.390	95.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.314%	USD	1'000.00	24.08.2017	28.08.2019	37 749 541		-	96.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.08.2017	28.08.2019	37 643 999	%	90.260	96.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on SMI	CHF	1'000.00	28.08.2017	28.08.2019	37 749 537	%	100.090	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Total	EUR	1'000.00	28.08.2017	28.08.2019	37 749 542	%	108.130	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities 29.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.528%	USD	1'000.00	29.08.2014	29.08.2019	24 565 388		-	91.650	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	29.08.2014	29.08.2019	24 565 431	%	96.970	90.620	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	USD	1'000.00	03.03.2016	29.08.2019	31 524 418	%	60.810	96.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.651%	SGD	1'000.00	29.08.2017	29.08.2019	37 644 067		-	97.410	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	SGD	1'000.00	29.08.2017	29.08.2019	37 644 068	%	96.990	97.410	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 28.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.917%	USD	1'000.00	30.08.2016	30.08.2019	33 597 573		-	96.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	30.08.2017	30.08.2019	37 749 882		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.089%	USD	1'000.00	30.08.2017	30.08.2019	37 749 881		-	96.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.08.2017	30.08.2019	37 749 571	%	65.870	96.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 2.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	31.08.2016	02.09.2019	33 597 588		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.03.2017	02.09.2019	35 551 052	%	57.510	95.900	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	03.09.2014	03.09.2019	24 565 517	%	79.610	90.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.09.2016	03.09.2019	33 597 559	%	61.740	96.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.08.2017	03.09.2019	37 749 528	%	96.110	96.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.08.2017	03.09.2019	37 749 710	%	100.140	96.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	07.03.2017	04.09.2019	35 550 950		-	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	29.08.2014	05.09.2019	24 205 085	%	45.070	91.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.09.2017	05.09.2019	37 749 597	%	98.730	96.970	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	05.09.2017	05.09.2019	37 749 901	%	98.080	97.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.165% 30.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	05.09.2017	05.09.2019	37 749 616		-	96.970	100.000	30.11.	0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P 27.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	05.09.2017	05.09.2019	37 749 749		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 3.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.895%	USD	1'000.00	06.09.2016	06.09.2019	33 597 599		-	96.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.09.2017	06.09.2019	37 749 807	%	92.460	97.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	06.09.2017	06.09.2019	37 749 806		-	97.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.09.2017	06.09.2019	37 749 801	%	96.110	97.050	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	06.09.2017	06.09.2019	37 749 795	%	86.140	97.050	100.000		0.000	Y
Capital Protected Certificate with Cap on SMI	GBP	1'000.00	09.09.2014	09.09.2019	24 565 564	%	102.720	90.880	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	09.09.2014	09.09.2019	24 565 591	%	89.040	91.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 31.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	09.09.2016	09.09.2019	33 597 478		-	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 31.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	09.09.2016	09.09.2019	33 597 477		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 31.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	09.09.2016	09.09.2019	33 597 462		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 31.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	09.09.2016	09.09.2019	33 597 463		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 31.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.944%	GBP	1'000.00	09.09.2016	09.09.2019	33 597 464		-	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 31.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.906%	USD	1'000.00	09.09.2016	09.09.2019	33 597 466		-	96.740	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 31.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.019%	USD	1'000.00	09.09.2016	09.09.2019	33 597 476		-	96.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 7.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.571%	CAD	1'000.00	09.09.2016	09.09.2019	33 597 400		-	97.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.179% 8.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	05.09.2017	10.09.2019	37 749 615		-	96.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.179%	USD	1'000.00	05.09.2017	10.09.2019	37 749 614		-	96.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.09.2017	10.09.2019	37 749 752	%	94.630	96.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 10.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	07.03.2017	11.09.2019	35 550 949		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.09.2014	12.09.2019	24 565 666	%	115.040	91.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.244%	USD	1'000.00	12.09.2017	12.09.2019	38 126 580		-	97.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.09.2017	12.09.2019	37 749 926	%	95.510	97.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.09.2014	16.09.2019	24 565 696	%	80.410	91.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	16.09.2014	16.09.2019	24 565 434	%	89.430	91.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	16.09.2016	16.09.2019	33 597 804	%	51.810	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.09.2017	16.09.2019	37 749 917	%	93.000	97.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Netflix Rg 14.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.216%	USD	1'000.00	11.09.2017	16.09.2019	37 749 854		-	96.990	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 15.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.765%	EUR	1'000.00	17.09.2015	17.09.2019	27 992 661		-	98.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 15.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.271%	USD	1'000.00	12.09.2017	17.09.2019	37 749 994		-	97.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.09.2017	19.09.2019	38 126 699	%	102.630	96.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.09.2017	19.09.2019	38 126 700	%	100.920	96.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.09.2017	20.09.2019	38 126 719	%	100.470	96.930	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	GBP	1'000.00	23.09.2014	23.09.2019	24 565 731	%	101.210	90.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	GBP	1'000.00	23.09.2014	23.09.2019	24 565 710	%	107.240	90.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2016-23.09.19 on Indices 20.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	22.09.2016	23.09.2019	33 851 327		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.167%	USD	1'000.00	23.09.2016	23.09.2019	33 851 143		-	96.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.444%	GBP	1'000.00	23.09.2016	23.09.2019	32 829 387		-	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	23.09.2016	23.09.2019	33 851 164		-	100.000	100.000		0.000	Y
10.25 % (4.09 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.03.2017	23.09.2019	35 550 660	%	102.760	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.026%	USD	1'000.00	21.09.2017	23.09.2019	38 126 848		-	97.080	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.09.2017	23.09.2019	38 126 937	%	20.380	96.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Airbus Br	EUR	1'000.00	22.09.2017	23.09.2019	38 126 627	%	100.590	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	24.09.2014	24.09.2019	25 444 895	%	130.530	90.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.09.2014	24.09.2019	24 565 698	%	73.260	97.590	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.09.2014	24.09.2019	24 565 697	%	76.060	91.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	CHF	1'000.00	25.09.2014	25.09.2019	24 565 712	%	102.080	98.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	25.09.2017	25.09.2019	38 126 743		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.09.2017	25.09.2019	38 126 781	%	68.270	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	25.09.2017	25.09.2019	38 126 725		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.09.2017	25.09.2019	38 126 764	%	100.430	96.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on SMI	CHF	1'000.00	25.09.2017	25.09.2019	38 126 745	%	98.170	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.09.2017	25.09.2019	38 126 762	%	70.290	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.09.2017	25.09.2019	38 126 742	%	80.180	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.029%	USD	1'000.00	25.09.2017	25.09.2019	38 126 784		-	96.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.09.2017	25.09.2019	38 126 786	%	92.820	96.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.029%	USD	1'000.00	25.09.2017	25.09.2019	38 126 785		-	96.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.09.2017	25.09.2019	38 126 783	%	94.840	96.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.09.2017	25.09.2019	38 126 769	%	94.540	96.820	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTXSD30 EUR P	USD	1'000.00	26.09.2014	26.09.2019	25 444 941	%	111.210	90.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 15.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.139%	USD	1'000.00	26.09.2017	26.09.2019	38 126 694		-	96.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on VanEck Gold Miners	USD	1'000.00	27.09.2017	27.09.2019	38 126 724	%	96.560	96.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 23.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.09.2017	27.09.2019	38 126 921		-	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTXSD30 EUR P	USD	1'000.00	30.09.2014	30.09.2019	25 444 943	%	110.090	90.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	EUR	1'000.00	13.10.2014	30.09.2019	25 444 960	%	96.550	97.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	GBP	1'000.00	13.10.2014	30.09.2019	25 444 959	%	98.810	90.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	13.10.2014	30.09.2019	25 444 958	%	96.600	90.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.03.2017	30.09.2019	35 550 774	%	98.950	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Funds	USD	1'000.00	30.03.2017	30.09.2019	36 170 994	%	104.670	95.870	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nestle N	CHF	1'000.00	30.03.2017	30.09.2019	35 550 767	%	108.520	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 29.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.703%	EUR	1'000.00	01.10.2014	01.10.2019	25 445 029		-	97.590	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.10.2015	02.10.2019	29 348 062	%	95.430	99.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on NATIXIS P	EUR	1'000.00	02.10.2017	02.10.2019	38 309 937	%	102.110	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BBVA Rg	USD	1'000.00	02.10.2017	02.10.2019	38 126 954	%	93.390	96.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.10.2017	02.10.2019	38 309 942	%	43.860	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.10.2017	03.10.2019	38 310 115	%	95.350	96.740	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Vale Sp ADR 22.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.128%	USD	1'000.00	03.10.2017	03.10.2019	38 126 909		-	96.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Petroleo Br Sp ADR	USD	1'000.00	03.10.2017	03.10.2019	38 126 910	%	94.910	96.780	100.000		0.000	Y
1.3 % on Bonds	USD	1'000.00	18.07.2014	04.10.2019	24 565 098	%	94.680	92.630	100.000	04.10.	12.660	Y
Protection Participation on Bonds	CHF	100.00	24.10.2014	04.10.2019	25 445 072	%	108.310	95.680	101.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	05.10.2017	04.10.2019	38 310 183	%	97.350	96.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.10.2014	07.10.2019	24 205 283	%	42.750	91.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.432%	USD	1'000.00	05.10.2016	07.10.2019	34 080 734		-	96.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	07.10.2016	07.10.2019	33 851 163	%	42.180	98.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 4.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	07.10.2016	07.10.2019	33 851 118		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 4.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.488%	USD	1'000.00	07.10.2016	07.10.2019	33 851 211		-	96.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Apple Rg	USD	1'000.00	02.10.2017	07.10.2019	38 309 932	%	101.020	96.640	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Alphabet Rg-A	USD	1'000.00	02.10.2017	07.10.2019	38 126 972	%	99.150	96.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Apple Rg	USD	1'000.00	02.10.2017	07.10.2019	38 126 973	%	99.720	96.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.10.2017	07.10.2019	38 309 929	%	98.310	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	09.10.2017	09.10.2019	38 310 024		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on SMI 6.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	10.10.2016	10.10.2019	33 851 219		-	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	10.04.2017	10.10.2019	36 170 808	%	99.380	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	10.10.2017	10.10.2019	38 310 036		-	96.700	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.10.2017	10.10.2019	38 310 244	%	105.650	96.610	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Basket	GBP	1'000.00	02.09.2015	11.10.2019	28 782 039	%	98.420	82.010	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 6.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	13.10.2016	11.10.2019	33 851 237		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.10.2017	11.10.2019	38 310 303	%	96.670	96.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.10.2017	11.10.2019	38 310 188	%	97.870	96.670	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	14.10.2016	14.10.2019	33 851 242		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	14.10.2016	14.10.2019	34 080 782	%	99.850	98.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Bank of America Rg	USD	1'000.00	10.10.2017	15.10.2019	38 310 247	%	101.250	96.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.10.2014	16.10.2019	25 445 076	%	91.830	97.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.10.2017	16.10.2019	38 310 248	%	101.180	96.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.10.2017	16.10.2019	38 310 035	%	99.690	96.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on USD 10Y Swap	USD	1'000.00	16.10.2017	16.10.2019	38 486 174	%	98.950	96.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.10.2017	16.10.2019	38 486 184	%	98.050	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.10.2017	16.10.2019	38 310 372	%	94.870	96.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.385%	GBP	1'000.00	17.10.2016	17.10.2019	34 080 789		-	98.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.10.2017	17.10.2019	38 310 305	%	82.030	96.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.10.2017	17.10.2019	38 310 255	%	92.100	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.834%	USD	1'000.00	18.10.2017	18.10.2019	38 310 390		-	96.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.71%	USD	1'000.00	18.10.2017	18.10.2019	38 310 301		-	96.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 20.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.162%	GBP	1'000.00	21.10.2014	21.10.2019	24 205 381		-	91.740	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.10.2016	21.10.2019	34 080 840	%	87.450	96.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.10.2017	21.10.2019	38 486 242	%	101.350	96.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	22.10.2014	22.10.2019	25 445 173	%	94.110	92.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.10.2017	22.10.2019	38 310 260	%	101.740	96.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.10.2017	23.10.2019	38 310 402	%	97.240	96.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.10.2017	23.10.2019	38 310 408	%	99.910	96.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.10.2017	23.10.2019	38 310 404	%	99.000	96.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.10.2017	23.10.2019	38 485 589	%	105.280	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.784%	USD	1'000.00	25.10.2017	23.10.2019	38 486 291		-	96.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.10.2014	24.10.2019	25 445 183	%	93.490	92.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 20.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.714%	EUR	1'000.00	24.04.2015	24.10.2019	27 339 632		-	99.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.10.2017	24.10.2019	38 485 638	%	98.220	96.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.10.2017	24.10.2019	38 486 203	%	100.150	96.570	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	24.10.2017	24.10.2019	38 486 262	%	96.110	96.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.10.2017	25.10.2019	38 310 096	%	101.540	96.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on USD 10Y Swap	USD	1'000.00	25.10.2017	25.10.2019	38 486 283	%	97.470	96.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	25.10.2017	25.10.2019	38 485 677	%	98.740	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	28.10.2014	28.10.2019	25 445 145	%	91.820	91.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 26.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.246%	GBP	1'000.00	28.10.2016	28.10.2019	34 080 436		-	98.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.933%	USD	1'000.00	28.04.2017	28.10.2019	36 170 910		-	96.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.10.2017	28.10.2019	38 485 616	%	100.110	96.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.10.2017	28.10.2019	38 485 615	%	99.820	96.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.10.2017	28.10.2019	38 485 617	%	99.190	96.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.10.2017	28.10.2019	38 485 764	%	99.340	96.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.10.2017	29.10.2019	38 485 655	%	98.260	96.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.10.2017	29.10.2019	38 485 654	%	100.440	96.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.10.2017	30.10.2019	38 486 114	%	104.770	96.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.10.2017	30.10.2019	38 486 351	%	101.520	96.460	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.10.2017	30.10.2019	38 486 115	%	96.280	96.510	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTXSD30 EUR P	USD	1'000.00	31.10.2014	31.10.2019	25 444 952	%	110.300	91.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTXBnk EUR P 27.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	31.10.2016	31.10.2019	34 080 512		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.10.2017	31.10.2019	38 485 760	%	81.850	96.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	31.10.2017	31.10.2019	38 485 948	%	88.750	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 27.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.821%	GBP	1'000.00	28.10.2014	01.11.2019	24 205 258		-	90.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.724%	USD	1'000.00	04.05.2017	04.11.2019	36 171 334		-	95.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	03.11.2017	04.11.2019	38 485 854		-	100.000	100.000	01.12.	0.000	Y
3.5 % (1.75 % p.a.) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.11.2017	04.11.2019	38 486 371	%	47.280	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	03.11.2017	04.11.2019	38 485 849		-	100.000	100.000	01.12.	0.000	Y
Protection Participation on MSCI WORLD INDEX	USD	1'000.00	05.11.2014	05.11.2019	25 923 917	%	115.600	91.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	05.05.2017	05.11.2019	36 171 335		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.11.2017	05.11.2019	38 486 228	%	106.700	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 4.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.241%	USD	1'000.00	25.10.2016	06.11.2019	33 851 454		-	96.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.11.2017	06.11.2019	38 485 993	%	99.630	96.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.11.2017	06.11.2019	38 485 978	%	95.120	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.11.2017	06.11.2019	38 485 858	%	93.220	96.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.11.2017	06.11.2019	38 486 317	%	98.900	96.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	GBP	1'000.00	07.11.2014	07.11.2019	24 205 477	%	84.100	91.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	07.11.2016	07.11.2019	34 080 960	%	79.990	97.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	07.11.2016	07.11.2019	34 080 958	%	94.260	97.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Commodities	USD	1'000.00	07.11.2017	07.11.2019	38 485 893	%	102.430	96.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.11.2017	07.11.2019	38 485 899	%	98.870	96.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Intesa Sanpaolo 6.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	25.10.2016	08.11.2019	33 851 453		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.11.2017	08.11.2019	38 485 999	%	94.900	96.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.11.2017	08.11.2019	38 486 003	%	99.500	96.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 10.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.809%	EUR	1'000.00	11.11.2015	11.11.2019	28 782 225		-	99.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	18.11.2016	11.11.2019	34 080 972		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on E.ON N 9.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	25.11.2016	11.11.2019	34 443 931		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Ferrovial	EUR	1'000.00	09.05.2017	11.11.2019	36 171 331	%	97.210	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.11.2015	12.11.2019	30 040 725	%	97.190	95.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.11.2017	13.11.2019	38 486 018	%	99.340	96.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.11.2017	13.11.2019	38 485 880	%	101.990	96.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.11.2017	13.11.2019	38 486 051	%	93.410	96.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	13.11.2017	13.11.2019	38 486 008	%	95.390	96.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.11.2014	14.11.2019	25 924 023	%	98.840	98.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on iShs MSCI Turkey 11.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.278%	USD	1'000.00	14.11.2016	14.11.2019	34 080 991		-	96.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.018%	USD	1'000.00	04.11.2016	15.11.2019	34 080 583		-	96.570	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	CHF	1'000.00	15.11.2016	15.11.2019	34 080 929	%	99.680	91.000	91.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 11.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.112%	USD	1'000.00	15.11.2016	15.11.2019	34 081 005		-	96.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	15.11.2017	15.11.2019	39 034 360	%	47.860	98.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.11.2017	15.11.2019	39 034 346	%	97.230	96.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.11.2017	15.11.2019	38 485 767	%	97.650	96.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.11.2017	15.11.2019	38 485 892	%	100.220	96.490	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Basket 11.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.127%	GBP	1'000.00	18.11.2014	18.11.2019	25 923 935		-	91.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.11.2014	18.11.2019	25 445 058	%	74.280	91.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	20.11.2019	38 486 454	%	98.360	96.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	20.11.2019	38 486 486	%	99.230	96.360	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.11.2017	20.11.2019	38 485 812	%	88.490	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on FTSE 100-Index	GBP	1'000.00	21.11.2014	21.11.2019	25 924 012	%	99.330	91.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.11.2015	25.11.2019	30 040 756	%	97.720	94.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.28%	USD	1'000.00	25.11.2016	25.11.2019	34 443 885		-	95.910	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	EUR	1'000.00	25.11.2016	25.11.2019	34 080 801	%	105.110	90.000	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	25.11.2019	38 485 802	%	99.720	96.410	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	25.11.2019	38 485 801	%	98.300	96.410	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	25.11.2019	38 485 803	%	96.480	96.410	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	25.11.2019	38 485 800	%	98.510	96.410	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on EDF 23.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	26.05.2017	26.11.2019	36 171 682		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 25.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.864%	EUR	1'000.00	27.11.2015	27.11.2019	28 782 280		-	99.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 25.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	18.11.2016	27.11.2019	34 443 619		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 25.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.567%	USD	1'000.00	18.11.2016	27.11.2019	34 443 631		-	96.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.12.2016	27.11.2019	34 540 844	%	73.880	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.11.2017	27.11.2019	39 034 400	%	90.700	96.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.11.2017	27.11.2019	39 034 489	%	98.350	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.11.2017	27.11.2019	39 034 411	%	99.370	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.11.2017	27.11.2019	39 034 410	%	99.230	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.11.2017	27.11.2019	39 034 398	%	89.200	96.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.11.2017	27.11.2019	39 034 399	%	92.940	96.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.11.2017	27.11.2019	39 034 401	%	91.310	96.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	28.11.2016	28.11.2019	34 540 760		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.11.2017	28.11.2019	39 034 502	%	99.430	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.11.2016	29.11.2019	34 540 849	%	10.140	95.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.11.2017	29.11.2019	39 034 537	%	101.070	96.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	29.11.2017	29.11.2019	39 164 176	%	100.000	96.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	02.12.2014	02.12.2019	25 923 856	%	93.280	91.740	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.12.2016	02.12.2019	34 540 822	%	6.750	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 30.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.602%	USD	1'000.00	04.12.2014	04.12.2019	25 822 967		-	91.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 30.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.641%	USD	1'000.00	04.12.2014	04.12.2019	25 822 966		-	92.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.954%	USD	1'000.00	22.11.2016	04.12.2019	34 443 859		-	95.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	27.11.2017	04.12.2019	39 034 445	%	98.060	96.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on TevaPharmInd Sp ADR	USD	1'000.00	04.12.2017	04.12.2019	39 034 454	%	102.850	96.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.12.2017	04.12.2019	39 034 574	%	96.650	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	05.12.2013	05.12.2019	22 406 750	%	84.460	88.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	05.12.2016	06.12.2019	33 597 799		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.12.2016	06.12.2019	34 765 617	%	10.060	95.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.12.2017	06.12.2019	39 163 994	%	101.300	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.12.2017	06.12.2019	39 163 992	%	96.240	96.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	EUR	1'000.00	06.12.2017	06.12.2019	39 163 974	%	98.260	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.12.2017	06.12.2019	39 163 973	%	100.870	96.250	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.12.2017	06.12.2019	39 163 966	%	95.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on AB InBev	EUR	1'000.00	07.12.2016	09.12.2019	34 540 624	%	90.500	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on UCB	EUR	1'000.00	07.12.2016	09.12.2019	34 540 623	%	106.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Engie	EUR	1'000.00	07.12.2016	09.12.2019	34 540 621	%	132.270	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on TevaPharmInd Sp ADR	USD	1'000.00	07.12.2016	09.12.2019	34 540 625	%	48.900	95.600	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 8.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.451%	GBP	1'000.00	09.12.2016	09.12.2019	34 765 640		-	97.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	09.12.2016	09.12.2019	34 540 879		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 5.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	09.12.2016	09.12.2019	34 540 880		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.847%	USD	1'000.00	09.12.2016	09.12.2019	34 540 882		-	95.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.838%	USD	1'000.00	09.12.2016	09.12.2019	34 540 881		-	95.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.051%	USD	1'000.00	06.06.2017	09.12.2019	36 786 454		-	96.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.12.2017	09.12.2019	39 164 208	%	95.540	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 11.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.085%	GBP	1'000.00	11.12.2014	11.12.2019	25 923 957		-	91.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	11.12.2014	11.12.2019	25 924 119	%	84.650	92.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 7.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.571%	EUR	1'000.00	11.12.2014	11.12.2019	25 823 002		-	97.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.12.2014	11.12.2019	25 924 118	%	83.250	91.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.12.2017	13.12.2019	39 034 302	%	95.620	96.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.12.2017	13.12.2019	39 164 048	%	90.540	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.12.2017	13.12.2019	39 164 223	%	46.810	96.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.12.2017	13.12.2019	39 164 224	%	46.970	96.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 14.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.302%	GBP	1'000.00	16.12.2014	16.12.2019	25 445 186		-	92.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 14.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.572%	EUR	1'000.00	16.12.2014	16.12.2019	25 924 163		-	97.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 15.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.973%	EUR	1'000.00	16.12.2015	16.12.2019	29 347 810		-	99.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 14.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.411%	USD	1'000.00	16.06.2016	16.12.2019	32 339 410		-	96.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.12.2017	16.12.2019	39 164 018	%	48.790	96.220	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	19.12.2016	19.12.2019	34 765 643	%	120.670	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 15.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.716%	USD	1'000.00	19.12.2016	19.12.2019	34 902 073		-	95.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.12.2017	19.12.2019	39 164 108	%	97.240	96.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.12.2017	20.12.2019	39 164 054	%	100.410	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 21.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.467%	USD	1'000.00	18.12.2014	23.12.2019	25 923 884		-	92.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	23.12.2014	23.12.2019	25 924 032	%	81.960	93.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.007%	USD	1'000.00	21.12.2016	23.12.2019	34 765 545		-	95.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.12.2016	23.12.2019	34 765 758	%	69.750	94.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.969%	USD	1'000.00	22.12.2016	23.12.2019	34 765 574		-	95.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.12.2016	23.12.2019	34 540 767	%	108.100	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	EUR	1'000.00	23.12.2016	23.12.2019	34 540 762	%	100.110	90.000	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.04.2017	23.12.2019	35 914 185	%	7.260	95.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	15.12.2017	23.12.2019	38 310 108	%	99.450	96.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.12.2017	23.12.2019	39 164 243	%	99.690	96.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 22.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.594%	USD	1'000.00	24.12.2014	24.12.2019	25 924 030		-	91.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Alibaba Grp Sp ADS	USD	1'000.00	20.12.2017	27.12.2019	39 164 152	%	96.520	96.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.12.2017	27.12.2019	39 164 261	%	95.300	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.12.2017	27.12.2019	39 164 260	%	97.230	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
StructuredNote Credit Linked on PEABODY ENERGY CORP	CHF	1'000.00	23.10.2014	03.01.2020	25 445 194	%	6.520	100.000	100.000	03.01.	55.763	N
(1.7 % min.) Structured Note on Raiffeisen Zentralbank	CHF	1'000.00	05.12.2014	03.01.2020	25 924 026	%	96.700	100.000	100.000	03.01. 03.04. 03.07. 05.10.	4.344 4.250 4.297 4.438	N
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	03.01.2017	03.01.2020	34 902 278	%	114.730	97.730	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.157%	USD	1'000.00	06.01.2017	06.01.2020	34 902 060		-	94.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	07.01.2016	07.01.2020	30 497 862	%	36.870	94.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	30.12.2016	09.01.2020	34 901 984		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	09.01.2017	09.01.2020	34 902 106	%	119.730	100.000	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	09.01.2017	09.01.2020	34 902 101	%	102.790	100.000	100.000	05.07.	0.000	N
Reverse Convertible on Equities 11.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	13.07.2016	13.01.2020	32 339 346		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.346%	USD	1'000.00	13.01.2017	13.01.2020	34 902 168		-	95.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	EUR	1'000.00	13.07.2017	13.01.2020	37 046 871	%	101.110	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	16.12.2016	14.01.2020	34 765 794		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	16.12.2016	14.01.2020	34 765 792		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nestle N	USD	1'000.00	15.01.2015	15.01.2020	25 924 244	%	117.440	92.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	17.01.2017	17.01.2020	35 135 109		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.01.2017	17.01.2020	35 135 136	%	102.290	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.01.2015	20.01.2020	26 674 523	%	87.950	98.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	21.01.2015	21.01.2020	25 924 214	%	99.750	92.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.429%	GBP	1'000.00	21.01.2015	21.01.2020	25 924 201		-	93.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.01.2015	23.01.2020	26 674 584	%	110.470	98.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.08.2016	23.01.2020	33 597 448	%	79.230	96.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 20.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.984%	USD	1'000.00	04.01.2017	23.01.2020	34 902 065		-	94.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.01.2017	23.01.2020	35 135 367	%	103.490	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.01.2017	24.01.2020	35 135 472	%	102.230	95.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	EUR	1'000.00	24.07.2017	24.01.2020	37 153 983	%	99.860	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 25.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	21.09.2016	27.01.2020	33 851 203		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	27.01.2017	27.01.2020	35 327 812	%	104.360	100.000	100.000		0.000	Y
5 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.01.2017	27.01.2020	35 135 294	%	101.970	100.000	100.000	25.07.	0.000	N
Reverse Convertible on Equities 26.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.548%	USD	1'000.00	25.01.2017	28.01.2020	35 327 734		-	95.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.196%	USD	1'000.00	27.01.2017	28.01.2020	35 135 473		-	94.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.214%	USD	1'000.00	17.01.2017	29.01.2020	35 135 094		-	95.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.709%	EUR	1'000.00	30.01.2015	30.01.2020	25 823 104		-	98.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 27.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.208%	USD	1'000.00	30.01.2017	30.01.2020	35 327 670		-	95.180	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.07.2017	31.01.2020	37 420 880	%	90.110	96.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	31.07.2017	31.01.2020	37 420 881	%	98.160	96.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	16.08.2017	31.01.2020	37 749 497	%	99.620	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 1.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	03.02.2017	03.02.2020	35 327 850		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	03.02.2017	03.02.2020	35 448 092	%	101.880	97.520	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	05.02.2014	05.02.2020	23 093 097	%	99.880	87.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.02.2015	05.02.2020	26 674 603	%	80.790	98.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.02.2015	05.02.2020	26 674 628	%	102.110	93.240	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Basket 2.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.31%	USD	1'000.00	09.02.2015	05.02.2020	26 674 551		-	93.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	05.08.2016	05.02.2020	33 244 682	%	85.570	98.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 3.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	20.01.2017	05.02.2020	35 135 169		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	10.02.2015	10.02.2020	26 674 648	%	69.160	93.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	10.02.2015	10.02.2020	25 924 256	%	88.900	94.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Porsche AutoHldgVz 8.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	10.02.2016	10.02.2020	30 040 827		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 10.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.226%	USD	1'000.00	23.01.2017	10.02.2020	35 135 175		-	95.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	10.02.2017	10.02.2020	35 327 628		-	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Funds	EUR	1'000.00	10.02.2017	10.02.2020	34 540 850	%	96.900	90.000	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	10.02.2017	10.02.2020	35 327 629		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 8.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	10.02.2017	10.02.2020	35 327 982		-	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	EUR	1'000.00	10.02.2017	10.02.2020	34 902 096	%	101.250	90.000	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.02.2017	10.02.2020	34 902 082	%	96.900	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.02.2017	10.02.2020	34 902 100	%	104.910	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.02.2015	11.02.2020	25 823 208	%	109.170	92.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	12.02.2016	12.02.2020	30 040 852	%	112.520	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.283%	USD	1'000.00	13.02.2017	13.02.2020	35 328 019		-	95.180	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 10.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.121%	USD	1'000.00	13.02.2017	13.02.2020	35 327 749		-	95.070	100.000		0.000	Y
Capital Protected-Cert. on Equities	EUR	1'000.00	17.02.2014	17.02.2020	22 226 824	%	112.210	92.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	25.02.2015	17.02.2020	26 674 570	%	80.080	98.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 15.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.378%	USD	1'000.00	15.02.2017	17.02.2020	35 550 819		-	95.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.02.2017	17.02.2020	35 327 889	%	98.890	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 15.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	17.02.2017	17.02.2020	35 447 763		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 15.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	17.08.2017	17.02.2020	37 420 922		-	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	17.02.2015	18.02.2020	26 674 789	%	98.180	92.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.02.2015	18.02.2020	26 674 714	%	87.440	92.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	18.02.2015	18.02.2020	26 674 608	%	120.640	93.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 16.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.741%	EUR	1'000.00	18.02.2015	18.02.2020	26 674 796		-	98.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.02.2015	18.02.2020	26 674 690	%	89.720	92.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	25.02.2015	18.02.2020	26 674 569	%	77.090	92.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 16.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.55% 16.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	19.02.2015	19.02.2020	26 674 795		-	92.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.02.2015	20.02.2020	26 674 588	%	53.780	98.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.02.2015	20.02.2020	26 674 587	%	72.280	98.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.02.2015	20.02.2020	26 674 589	%	57.270	98.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 19.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.707%	USD	1'000.00	20.02.2015	20.02.2020	25 823 227		-	91.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	SEK	1'000.00	10.02.2015	24.02.2020	26 674 647	%	127.550	97.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.02.2017	24.02.2020	35 447 838	%	64.630	94.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	01.03.2017	24.02.2020	35 447 922		-	100.000	100.000		0.000	Y
Express-Cert. on Basket	GBP	1'000.00	25.02.2014	25.02.2020	23 580 923	%	130.750	87.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	22.12.2015	25.02.2020	30 041 180	%	2.340	99.910	100.000	24.02. 23.05. 23.08. 23.11.	0.100 0.100 0.110 0.110	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	22.12.2015	25.02.2020	30 041 181	%	4.070	99.910	100.000	24.02. 23.05. 23.08. 23.11.	0.100 0.100 0.110 0.110	Y
5 % Reverse Convertible on Indices 24.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	26.02.2016	26.02.2020	31 524 332		-	100.000	100.000	24.02. 24.05.	0.000 0.000	N
Underlying Tracker on iShs MSCI Pac Ex-Ja	USD	1'000.00	27.02.2015	27.02.2020	27 214 198	%	105.700	91.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 29.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.408%	CAD	1'000.00	10.02.2017	27.02.2020	35 327 964		-	96.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.02.2017	27.02.2020	35 447 925		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	28.02.2017	28.02.2020	35 551 006	%	105.180	97.990	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	28.02.2017	28.02.2020	35 551 005	%	99.620	97.990	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Funds	USD	1'000.00	02.03.2015	02.03.2020	26 674 792	%	117.260	91.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	03.03.2015	03.03.2020	26 674 808	%	116.150	92.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 31.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.206%	USD	1'000.00	14.02.2017	04.03.2020	35 328 046		-	95.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Generali N 31.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	28.02.2017	04.03.2020	35 447 818		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	05.03.2015	05.03.2020	26 674 568	%	76.000	92.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.03.2015	05.03.2020	25 924 315	%	96.740	92.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.02.2017	05.03.2020	35 447 791	%	92.080	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.254% 2.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	07.03.2017	06.03.2020	35 551 016		-	95.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	09.03.2015	09.03.2020	27 214 270	%	89.780	98.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.834%	USD	1'000.00	09.03.2015	09.03.2020	26 674 814		-	92.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.616%	USD	1'000.00	09.03.2015	09.03.2020	27 214 266		-	92.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.03.2015	09.03.2020	26 674 726	%	63.190	92.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.762%	USD	1'000.00	20.03.2015	09.03.2020	26 674 821		-	92.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Nestle N 7.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	24.02.2017	09.03.2020	35 447 896		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 8.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.874%	USD	1'000.00	09.03.2017	09.03.2020	35 448 217		-	94.730	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	17.03.2015	10.03.2020	26 674 835	%	94.680	92.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	10.03.2017	10.03.2020	35 551 034	%	100.860	98.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.03.2017	10.03.2020	35 550 463	%	80.730	94.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	11.03.2015	11.03.2020	26 674 737	%	33.970	92.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.03.2015	12.03.2020	26 674 622	%	96.400	91.740	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	12.03.2015	12.03.2020	26 674 567	%	79.220	98.510	100.000		0.000	Y
Protection Participation on STXE6 EUR P	USD	1'000.00	16.03.2015	12.03.2020	26 673 930	%	89.850	82.580	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 11.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	13.03.2017	13.03.2020	35 914 135		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 11.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.639%	USD	1'000.00	14.03.2017	13.03.2020	35 550 508		-	94.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	CAD	1'000.00	26.01.2016	16.03.2020	30 497 990	%	84.720	97.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.842%	USD	1'000.00	15.03.2017	16.03.2020	35 448 188		-	94.730	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.03.2015	17.03.2020	26 673 924	%	61.040	91.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 14.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.691%	USD	1'000.00	17.03.2017	17.03.2020	35 550 613		-	94.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.03.2017	17.03.2020	35 550 957	%	99.820	94.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 14.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.691%	USD	1'000.00	17.03.2017	17.03.2020	35 550 615		-	94.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.03.2015	18.03.2020	27 339 358	%	85.570	98.760	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.03.2015	18.03.2020	27 339 357	%	63.260	98.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	18.03.2016	18.03.2020	30 041 100	%	111.530	100.000	100.000		0.000	Y
Structured Note on Equities	GBP	1'000.00	19.03.2015	19.03.2020	26 674 813	%	84.430	83.260	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.03.2015	20.03.2020	27 214 281	%	76.220	98.410	100.000		0.000	Y
Capital Protection-Cert. on STOXX Europe 600-Index	GBP	1'000.00	20.03.2015	20.03.2020	26 673 937	%	92.350	82.850	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 16.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.293%	USD	1'000.00	20.03.2015	20.03.2020	27 339 367		-	91.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BNP Paribas-A- 21.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.818%	USD	1'000.00	10.03.2017	20.03.2020	35 550 436		-	94.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	23.03.2015	23.03.2020	27 339 254	%	96.990	93.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.03.2017	23.03.2020	35 550 866	%	100.710	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.03.2017	23.03.2020	35 550 852	%	101.570	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	23.03.2017	23.03.2020	35 551 017	%	99.270	98.160	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Funds	EUR	1'000.00	23.03.2017	23.03.2020	35 914 211	%	95.620	89.890	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.727%	USD	1'000.00	23.03.2017	23.03.2020	35 550 585		-	94.590	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.03.2017	23.03.2020	35 914 183	%	96.140	99.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Banco BPM Nm 21.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.895% 21.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	23.03.2017	23.03.2020	35 550 703		-	99.940	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	EUR	1'000.00	23.03.2017	23.03.2020	35 550 865	%	104.940	90.000	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.03.2017	23.03.2020	35 550 868	%	98.720	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.091% 21.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	GBP	1'000.00	24.03.2017	24.03.2020	35 550 953		-	97.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.839%	USD	1'000.00	24.03.2017	24.03.2020	35 550 706		-	94.450	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Nestle N	USD	1'000.00	25.03.2015	25.03.2020	27 339 363	%	107.750	91.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	26.03.2015	26.03.2020	26 673 953	%	97.180	98.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.09.2017	26.03.2020	38 126 872	%	95.460	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.09.2017	26.03.2020	38 126 873	%	95.250	96.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on TripAdvisor Rg	EUR	1'000.00	23.03.2017	27.03.2020	35 550 649	%	87.660	99.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.64%	USD	1'000.00	27.03.2017	27.03.2020	35 550 638		-	94.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Air France - KLM 28.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.86%	EUR	1'000.00	30.03.2017	30.03.2020	35 914 293		-	99.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	01.04.2015	01.04.2020	26 673 991	%	98.090	98.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	01.04.2015	01.04.2020	27 339 311	%	85.330	92.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 30.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	01.04.2016	01.04.2020	31 185 343		-	100.000	100.000		0.000	Y
Capital Protected-Cert. with reference bond	EUR	1'000.00	11.04.2014	03.04.2020	23 580 915	%	93.760	93.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.04.2015	03.04.2020	26 674 043	%	62.940	92.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	03.04.2017	03.04.2020	36 171 005	%	96.130	97.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	03.04.2017	03.04.2020	36 171 007	%	93.730	97.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	03.04.2017	03.04.2020	36 171 006	%	90.970	97.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 5.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	09.03.2017	06.04.2020	35 448 186		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	06.04.2017	06.04.2020	35 550 725	%	88.100	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	06.04.2017	06.04.2020	36 170 776	%	98.820	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 5.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.558%	USD	1'000.00	07.04.2016	07.04.2020	31 524 585		-	95.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.04.2017	07.04.2020	36 171 021	%	100.790	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	07.04.2017	07.04.2020	36 171 022	%	100.430	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.04.2015	08.04.2020	27 214 265	%	92.200	92.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	08.04.2015	08.04.2020	26 674 017	%	97.970	98.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	09.04.2015	09.04.2020	27 339 345	%	96.930	92.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	13.04.2015	13.04.2020	27 339 347	%	80.210	93.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 13.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.947%	CAD	1'000.00	13.03.2017	13.04.2020	35 550 481		-	96.270	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 8.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.062%	USD	1'000.00	13.04.2017	13.04.2020	36 171 092		-	94.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on CRITEO Sp ADS	USD	1'000.00	13.10.2017	13.04.2020	38 310 319	%	59.650	95.640	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	14.04.2015	14.04.2020	26 674 046	%	106.550	98.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	20.04.2015	20.04.2020	26 674 812	%	79.260	93.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	20.04.2015	20.04.2020	27 339 532	%	65.630	93.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Total	USD	1'000.00	20.04.2017	20.04.2020	36 170 876	%	93.830	95.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Vinci 12.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.063%	USD	1'000.00	20.04.2017	20.04.2020	36 170 875		-	95.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.04.2017	20.04.2020	36 170 850	%	92.490	95.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.939%	USD	1'000.00	20.04.2017	20.04.2020	36 170 871		-	95.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.03.2017	21.04.2020	35 550 726	%	103.930	94.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.03.2017	21.04.2020	35 550 727	%	100.260	94.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.04.2015	22.04.2020	26 674 140	%	73.500	92.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	22.04.2016	22.04.2020	31 524 649	%	110.930	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.03.2017	22.04.2020	35 914 201	%	26.290	99.850	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	25.04.2014	24.04.2020	24 205 511	%	63.940	93.590	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Credit Agricole	USD	1'000.00	24.04.2015	24.04.2020	26 674 111	%	90.640	92.730	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on BP	USD	1'000.00	24.04.2015	24.04.2020	26 674 108	%	99.160	92.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.10.2017	24.04.2020	38 485 626	%	98.220	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	24.10.2017	24.04.2020	38 485 625	%	95.630	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.04.2015	27.04.2020	26 674 129	%	82.400	92.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.446%	GBP	1'000.00	27.04.2015	27.04.2020	27 339 527		-	93.560	100.000		0.000	Y
Structured Note on Equities	GBP	1'000.00	27.04.2015	27.04.2020	27 339 268	%	93.590	89.820	96.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	27.04.2015	27.04.2020	26 674 209	%	100.080	93.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.04.2017	27.04.2020	36 171 304	%	55.540	95.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	27.04.2017	27.04.2020	36 171 043	%	90.740	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	27.04.2017	27.04.2020	36 171 045	%	93.830	98.220	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	GBP	1'000.00	28.04.2014	28.04.2020	23 581 284	%	104.410	87.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Telefonica	USD	1'000.00	28.04.2015	28.04.2020	26 674 139	%	45.500	93.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.04.2015	29.04.2020	26 674 165	%	47.250	93.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	GBP	1'000.00	29.04.2015	29.04.2020	27 339 335	%	100.020	93.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.04.2015	29.04.2020	26 674 164	%	48.630	93.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.04.2015	29.04.2020	26 674 163	%	49.060	93.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.04.2015	29.04.2020	26 674 166	%	81.210	93.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	30.04.2015	29.04.2020	27 339 318	%	103.610	92.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	30.04.2015	30.04.2020	27 339 713	%	91.930	92.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.04.2015	30.04.2020	26 674 203	%	87.990	93.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on iShs Nasdaq Biotech	USD	1'000.00	01.05.2017	30.04.2020	36 170 898	%	100.180	95.300	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	EUR	1'000.00	04.05.2017	04.05.2020	35 914 190	%	92.020	90.000	90.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	USD	1'000.00	05.05.2014	05.05.2020	23 581 280	%	100.670	88.380	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Royal Dutch Shell-A	USD	1'000.00	05.05.2015	05.05.2020	26 674 187	%	80.230	92.870	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Funds	EUR	1'000.00	05.05.2017	05.05.2020	35 914 151	%	94.860	90.000	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.05.2017	05.05.2020	36 171 314	%	99.030	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.05.2017	05.05.2020	35 914 140	%	99.890	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	GBP	1'000.00	06.05.2014	06.05.2020	24 205 539	%	103.410	87.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.05.2015	06.05.2020	27 991 963	%	84.380	92.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.05.2015	06.05.2020	27 339 732	%	115.730	93.010	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Banca MPS	USD	1'000.00	20.05.2014	07.05.2020	24 205 730	%	1.000	89.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Index-Basket	USD	1'000.00	07.05.2015	07.05.2020	26 674 757	%	58.310	92.600	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur GrpN	USD	1'000.00	07.05.2015	07.05.2020	26 674 255	%	99.200	92.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 4.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	GBP	1'000.00	13.05.2015	07.05.2020	27 339 649		-	93.080	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	EUR	1'000.00	13.05.2015	07.05.2020	26 674 273	%	132.470	98.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.05.2017	11.05.2020	36 171 177	%	22.550	95.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.918%	USD	1'000.00	11.05.2017	11.05.2020	36 171 178		-	95.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	12.05.2015	12.05.2020	27 991 983	%	60.150	92.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	12.05.2015	12.05.2020	27 991 982	%	75.870	92.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	12.05.2015	12.05.2020	27 992 004	%	107.340	92.280	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.05.2017	12.05.2020	36 170 970	%	91.620	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 10.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	12.05.2017	12.05.2020	36 170 969		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 10.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	12.05.2017	12.05.2020	36 171 550		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	13.05.2015	13.05.2020	27 992 029	%	111.020	97.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	14.05.2015	14.05.2020	26 674 302	%	102.090	98.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	14.05.2015	14.05.2020	27 992 039	%	98.440	97.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BNP Paribas-A- 16.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	20.04.2017	14.05.2020	36 170 825		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 16.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	20.04.2017	14.05.2020	36 170 826		-	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	15.05.2014	15.05.2020	24 205 557	%	96.660	87.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 11.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.221%	EUR	1'000.00	15.05.2015	15.05.2020	26 674 376		-	98.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.05.2015	18.05.2020	27 992 754	%	117.910	92.140	100.000		0.000	Y
Protection Participation on STXE6 EUR P	GBP	1'000.00	26.05.2015	18.05.2020	26 674 386	%	92.970	83.240	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	18.05.2017	18.05.2020	30 041 282	%	100.810	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 17.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.476%	USD	1'000.00	19.05.2015	19.05.2020	26 674 326		-	92.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 17.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.136%	EUR	1'000.00	19.05.2015	19.05.2020	26 674 409		-	97.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 17.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.327% 17.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	19.05.2015	19.05.2020	26 674 410		-	91.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.05.2015	19.05.2020	26 674 412	%	98.200	97.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 17.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.889%	GBP	1'000.00	19.05.2015	19.05.2020	27 991 977		-	92.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.853%	GBP	1'000.00	19.05.2015	19.05.2020	26 674 395		-	92.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on DAXK-Index	EUR	1'000.00	19.05.2015	19.05.2020	27 992 771	%	103.380	97.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 15.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	23.05.2017	19.05.2020	36 171 431		-	100.000	100.000		0.000	Y
Express-Cert. on Basket 16.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.31%	EUR	1'000.00	06.05.2014	20.05.2020	20 454 919		-	93.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 18.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.179%	EUR	1'000.00	20.05.2015	20.05.2020	26 674 426		-	98.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.05.2015	20.05.2020	26 674 422	%	87.800	97.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 22.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.953%	GBP	1'000.00	20.05.2015	20.05.2020	26 674 341		-	92.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.05.2015	20.05.2020	26 674 413	%	96.500	91.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 20.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.082%	USD	1'000.00	22.05.2017	22.05.2020	36 171 455		-	95.120	100.000		0.000	Y
12.5 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.05.2017	25.05.2020	36 171 710	%	55.160	100.000	100.000	26.05.	0.000	Y
10.5 % Reverse Convertible on Equities 22.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	23.05.2017	25.05.2020	36 171 711		-	100.000	100.000	26.05.	0.000	Y
12.2 % Reverse Convertible on Equities 3.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	23.05.2017	25.05.2020	36 171 712		-	100.000	100.000	26.05.	0.000	Y
12.6 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.05.2017	25.05.2020	36 171 713	%	39.850	100.000	100.000	26.05.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	AUD	1'000.00	25.05.2017	25.05.2020	36 171 031	%	97.950	94.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	AUD	1'000.00	25.05.2017	25.05.2020	36 171 030	%	90.300	94.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 23.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	25.05.2017	25.05.2020	36 171 727		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.05.2015	26.05.2020	26 674 447	%	77.510	97.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	26.05.2015	26.05.2020	27 991 954	%	103.940	92.690	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur GrpN	USD	1'000.00	26.05.2015	26.05.2020	26 674 331	%	92.500	92.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	26.05.2015	26.05.2020	27 339 729	%	87.820	92.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.05.2015	26.05.2020	26 674 392	%	50.050	92.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	26.05.2015	26.05.2020	26 674 458	%	95.600	98.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	26.05.2015	26.05.2020	27 992 753	%	117.240	92.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.05.2017	26.05.2020	36 171 733	%	92.780	95.210	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Funds 24.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.884%	USD	1'000.00	27.05.2015	27.05.2020	27 339 655		-	92.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.05.2015	27.05.2020	27 992 758	%	27.430	91.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	27.05.2016	27.05.2020	31 185 665	%	110.630	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices 30.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.265%	GBP	1'000.00	28.05.2014	28.05.2020	24 205 709		-	87.710	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	28.05.2015	28.05.2020	26 674 486	%	94.120	97.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 24.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	28.05.2015	28.05.2020	26 674 475		-	100.000	100.000		0.000	Y
Express Certificate on PT Telecom SGPSN	EUR	1'000.00	29.05.2014	29.05.2020	24 205 827	%	6.580	94.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	29.05.2015	29.05.2020	27 339 663	%	73.980	92.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	29.05.2015	29.05.2020	27 992 842	%	99.550	92.320	100.000		0.000	Y
Protection Participation on STXE6Uti EUR P	USD	1'000.00	29.05.2015	29.05.2020	26 674 482	%	95.300	92.100	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	29.05.2015	29.05.2020	26 674 481	%	97.850	92.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.06.2015	29.05.2020	27 992 868	%	1.060	91.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.929%	EUR	1'000.00	12.06.2015	29.05.2020	28 370 799		-	97.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 27.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.809%	GBP	1'000.00	01.06.2015	01.06.2020	27 991 988		-	92.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.024%	GBP	1'000.00	08.06.2015	01.06.2020	26 674 519		-	92.580	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.11.2017	01.06.2020	39 034 544	%	43.110	95.310	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	USD	1'000.00	02.06.2014	02.06.2020	24 205 676	%	90.860	89.270	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Funds	USD	1'000.00	05.06.2014	02.06.2020	24 205 614	%	93.690	89.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.06.2015	02.06.2020	26 674 493	%	90.780	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.041%	GBP	1'000.00	16.06.2015	02.06.2020	27 992 884		-	92.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.73%	USD	1'000.00	05.05.2017	02.06.2020	36 171 154		-	94.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	02.06.2017	02.06.2020	30 041 283		-	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	USD	1'000.00	10.06.2014	03.06.2020	24 205 613	%	82.440	89.300	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur GrpN	EUR	1'000.00	03.06.2015	03.06.2020	27 992 877	%	80.490	98.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.596%	USD	1'000.00	03.06.2016	03.06.2020	31 185 703		-	95.230	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	04.06.2014	04.06.2020	24 205 755	%	92.400	89.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.06.2015	04.06.2020	27 992 082	%	97.320	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	GBP	1'000.00	05.06.2014	05.06.2020	24 205 776	%	104.600	88.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.06.2015	05.06.2020	28 370 783	%	95.670	92.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 1.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.90%	USD	1'000.00	05.06.2015	05.06.2020	27 992 830		-	92.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	01.06.2017	05.06.2020	36 786 169		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	01.06.2017	05.06.2020	36 786 166	%	93.550	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.06.2017	05.06.2020	36 786 455	%	91.270	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.06.2015	08.06.2020	27 992 873	%	82.020	92.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.06.2017	08.06.2020	36 786 451	%	114.370	95.170	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on UBS Group N	USD	1'000.00	09.06.2015	09.06.2020	27 992 053	%	81.890	91.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	09.06.2015	09.06.2020	27 992 892	%	88.690	98.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	09.06.2017	09.06.2020	36 786 503		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	10.06.2015	10.06.2020	27 992 790	%	96.920	91.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	GBP	1'000.00	10.06.2015	10.06.2020	27 992 032	%	122.760	92.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.12.2017	11.06.2020	39 164 027	%	98.650	95.120	100.000		0.000	Y
Protection Participation on STXE6Uti EUR P	USD	1'000.00	12.06.2015	12.06.2020	26 674 505	%	96.430	91.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.134%	USD	1'000.00	16.06.2017	12.06.2020	36 786 427		-	95.310	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 13.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.555%	USD	1'000.00	15.12.2016	15.06.2020	34 765 791		-	94.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.601%	USD	1'000.00	15.12.2016	15.06.2020	34 765 575		-	94.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.06.2017	15.06.2020	36 786 490	%	94.830	95.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.176%	USD	1'000.00	15.06.2017	15.06.2020	36 786 497		-	95.210	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	15.06.2017	15.06.2020	36 786 401		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Azimut Holding N 11.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	15.06.2017	15.06.2020	30 041 288		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	16.06.2015	16.06.2020	27 992 172	%	90.570	97.250	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.06.2017	16.06.2020	36 171 235	%	99.510	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.06.2017	16.06.2020	36 786 294	%	98.530	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.06.2017	16.06.2020	36 171 236	%	96.340	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	EUR	1'000.00	16.06.2017	16.06.2020	36 171 232	%	90.120	90.000	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 15.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.763%	EUR	1'000.00	17.06.2015	17.06.2020	27 992 187		-	97.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 15.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.763%	EUR	1'000.00	17.06.2015	17.06.2020	27 992 185		-	97.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 15.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.763%	EUR	1'000.00	17.06.2015	17.06.2020	27 992 186		-	97.100	100.000		0.000	Y
Capped Airbag on iShs FTSE 100 GBP	GBP	1'000.00	18.06.2014	18.06.2020	24 564 762	%	109.750	87.300	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	18.06.2014	18.06.2020	23 581 374	%	90.760	88.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 19.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.958%	USD	1'000.00	15.06.2017	18.06.2020	36 786 341		-	95.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Lvmh 15.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	19.12.2016	19.06.2020	34 765 685		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Bayer N 15.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	19.12.2016	19.06.2020	34 765 687		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Renault 15.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	19.12.2016	19.06.2020	34 765 684		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.094%	USD	1'000.00	16.06.2017	19.06.2020	36 786 339		-	95.250	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	19.06.2017	19.06.2020	37 046 968		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.12.2017	19.06.2020	39 164 226	%	97.280	95.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.12.2017	19.06.2020	39 164 324	%	94.860	95.170	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	11.06.2014	22.06.2020	24 205 729	%	86.650	94.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	22.06.2015	22.06.2020	27 992 818	%	87.790	97.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Renault 20.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	22.12.2016	22.06.2020	34 765 706		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	22.06.2017	22.06.2020	36 786 624		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 20.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	22.06.2017	22.06.2020	36 786 598		-	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on WsdmTr India Earnin	USD	1'000.00	14.12.2017	22.06.2020	38 310 107	%	98.090	95.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.12.2017	22.06.2020	39 164 339	%	93.810	94.970	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	USD	1'000.00	23.06.2014	23.06.2020	24 205 849	%	78.180	88.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.06.2017	24.06.2020	36 786 567	%	55.720	95.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 22.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.232%	USD	1'000.00	26.06.2017	26.06.2020	37 046 663		-	95.290	100.000		0.000	Y
Express-Cert. on Equities 28.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.323%	EUR	1'000.00	16.06.2014	29.06.2020	23 092 995		-	93.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Axa 27.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	29.12.2016	29.06.2020	34 901 973		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.06.2017	29.06.2020	37 046 721	%	89.250	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.917%	GBP	1'000.00	01.07.2015	01.07.2020	27 992 850		-	91.510	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	02.07.2014	02.07.2020	24 204 893	%	76.800	94.820	100.000	29.09.	10.180	Y
Contingent Capital Protection on Bonds	EUR	1'000.00	24.04.2014	03.07.2020	23 581 216	%	95.380	84.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 30.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	03.01.2017	03.07.2020	34 902 285		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTXBnk EUR P 30.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	03.01.2017	03.07.2020	34 902 286		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.07.2017	03.07.2020	37 046 766	%	73.930	95.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	03.07.2017	03.07.2020	37 046 762	%	97.800	100.000	100.000		0.000	Y
Contingent Capital Protected-Cert. on Basket with Reference Bond	EUR	1'000.00	17.07.2014	06.07.2020	24 205 826	%	91.900	93.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 29.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.407%	EUR	1'000.00	06.07.2015	06.07.2020	27 992 305		-	97.490	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	EUR	1'000.00	20.07.2015	06.07.2020	27 992 307	%	44.710	97.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	06.07.2017	06.07.2020	37 046 776	%	98.070	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	06.07.2017	06.07.2020	36 171 511	%	88.860	98.020	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Currencies	USD	1'000.00	07.07.2014	07.07.2020	24 564 862	%	81.400	89.010	100.000	02.10.	19.079	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	07.07.2014	07.07.2020	24 204 896	%	79.330	95.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Gerdau Sp.ADR Pfd	USD	1'000.00	08.10.2014	07.07.2020	25 445 055	%	9.780	88.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 4.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.652%	EUR	1'000.00	07.07.2015	07.07.2020	28 371 018		-	97.590	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	07.07.2015	07.07.2020	27 992 854	%	31.850	92.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.07.2015	07.07.2020	28 371 014	%	93.020	97.590	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.07.2015	07.07.2020	27 992 853	%	33.850	98.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.07.2015	07.07.2020	27 992 855	%	28.740	92.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.12.2017	07.07.2020	39 164 150	%	93.580	94.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	08.07.2015	08.07.2020	28 371 049	%	88.430	91.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 5.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.564%	EUR	1'000.00	08.07.2015	08.07.2020	28 371 079		-	97.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 5.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.555%	EUR	1'000.00	08.07.2015	08.07.2020	28 371 078		-	97.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	08.07.2015	08.07.2020	28 370 957	%	113.560	91.830	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	EUR	1'000.00	09.07.2014	09.07.2020	24 564 962	%	98.040	95.100	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	EUR	1'000.00	09.07.2014	09.07.2020	24 564 961	%	93.600	95.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 7.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.548%	USD	1'000.00	09.07.2015	09.07.2020	27 992 334		-	91.600	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	GBP	1'000.00	10.07.2014	10.07.2020	24 564 760	%	92.290	88.900	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	USD	1'000.00	10.07.2014	10.07.2020	24 564 930	%	127.660	88.950	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	10.07.2014	10.07.2020	24 564 869	%	69.240	95.160	100.000		0.000	Y
Structured Note on Basket	EUR	1'000.00	15.05.2015	13.07.2020	27 339 529	%	95.900	95.580	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Basket	EUR	10'000.00	15.05.2015	13.07.2020	27 992 044	%	100.200	80.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.04.2016	13.07.2020	31 524 611	%	16.010	100.000	100.000	11.01. 11.04. 11.07. 11.10.	0.000 0.000 0.000 0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	13.07.2017	13.07.2020	30 041 294	%	93.300	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on SMI	CHF	1'000.00	13.07.2017	13.07.2020	37 046 887	%	101.160	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	13.07.2017	13.07.2020	37 153 930	%	97.410	99.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.112%	USD	1'000.00	14.07.2015	14.07.2020	28 371 030		-	92.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 12.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.361%	EUR	1'000.00	14.07.2015	14.07.2020	27 992 321		-	97.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.07.2015	14.07.2020	27 992 356	%	94.110	97.730	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	GBP	1'000.00	15.07.2014	15.07.2020	24 204 935	%	105.860	86.840	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	USD	1'000.00	15.07.2014	15.07.2020	24 564 946	%	79.690	88.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.07.2015	15.07.2020	28 371 048	%	47.840	97.730	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 13.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.937%	USD	1'000.00	15.07.2015	15.07.2020	28 370 959		-	92.190	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices 14.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.657%	GBP	1'000.00	16.07.2014	16.07.2020	24 565 017		-	86.990	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.07.2015	16.07.2020	28 371 072	%	48.040	92.100	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	30.07.2015	16.07.2020	27 992 377	%	101.710	97.850	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	EUR	1'000.00	17.07.2014	17.07.2020	24 565 073	%	107.920	95.330	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	17.07.2015	17.07.2020	28 781 810	%	90.990	87.150	95.000		0.000	Y
Protection Participation on STXE50 EUR P	GBP	1'000.00	31.07.2015	17.07.2020	27 992 386	%	84.740	82.740	90.000		0.000	Y
Protection Participation on STXE50 EUR P	USD	1'000.00	31.07.2015	17.07.2020	27 992 385	%	81.970	82.610	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.07.2017	17.07.2020	37 046 854	%	100.390	94.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 20.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.287%	EUR	1'000.00	20.07.2015	20.07.2020	27 992 392		-	97.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	20.07.2015	20.07.2020	28 371 076	%	113.480	91.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.07.2016	20.07.2020	32 829 641	%	13.290	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	100.00	26.07.2016	20.07.2020	32 829 368	%	10.730	96.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 18.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	20.01.2017	20.07.2020	35 135 191		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BNP Paribas-A-	USD	1'000.00	09.06.2017	20.07.2020	36 786 367	%	102.250	95.090	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	18.07.2017	20.07.2020	37 153 978	%	100.220	99.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Banco BPM Nm	EUR	1'000.00	20.07.2017	20.07.2020	37 153 865	%	92.060	99.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	21.07.2015	21.07.2020	27 992 406	%	100.800	97.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.566%	USD	1'000.00	21.07.2016	21.07.2020	32 829 663		-	96.100	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	EUR	1'000.00	21.07.2017	21.07.2020	36 786 326	%	92.710	89.950	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.07.2017	21.07.2020	36 786 324	%	103.150	99.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.07.2017	21.07.2020	36 786 311	%	98.630	99.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on S&P GSCI Crd OilER	USD	1'000.00	22.07.2015	22.07.2020	27 992 370	%	89.640	92.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.07.2015	22.07.2020	28 370 961	%	12.840	91.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.07.2015	23.07.2020	28 371 418	%	107.100	91.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Credit Agricole	EUR	1'000.00	05.06.2017	23.07.2020	36 786 254	%	101.440	99.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Credit Agricole	USD	500.00	05.06.2017	23.07.2020	36 786 256	%	102.080	95.000	100.000		0.000	Y
Cpc with Participation on Funds	USD	1'000.00	24.07.2014	24.07.2020	24 565 088	%	110.280	79.870	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 20.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.222%	USD	1'000.00	24.07.2017	24.07.2020	36 171 284		-	95.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.07.2017	24.07.2020	37 153 996	%	61.300	95.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Peugeot 25.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	26.07.2016	27.07.2020	33 244 683		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.07.2017	27.07.2020	37 420 805	%	83.940	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.251%	USD	1'000.00	27.07.2017	27.07.2020	37 153 997		-	95.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	28.07.2015	28.07.2020	28 781 835	%	104.970	91.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	28.07.2015	28.07.2020	27 992 438	%	95.270	97.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	29.07.2015	29.07.2020	28 371 075	%	108.900	91.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	07.08.2015	29.07.2020	28 370 988	%	100.980	97.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.07.2015	30.07.2020	28 371 047	%	80.150	91.560	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	GBP	10'000.00	25.07.2017	30.07.2020	37 153 814	%	100.320	97.710	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	31.07.2014	31.07.2020	24 565 180	%	15.930	87.300	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	31.07.2014	31.07.2020	24 205 871	%	117.700	95.390	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	31.07.2017	31.07.2020	37 420 882	%	101.580	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.08.2017	03.08.2020	37 643 906	%	76.710	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 1.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	03.08.2017	03.08.2020	37 420 913		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.08.2017	03.08.2020	37 643 905	%	100.800	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.08.2015	04.08.2020	28 781 866	%	91.040	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.781%	USD	1'000.00	01.06.2017	04.08.2020	36 171 667		-	94.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	05.08.2015	05.08.2020	28 781 888	%	57.350	91.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.08.2015	05.08.2020	27 992 473	%	80.600	91.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 4.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	16.01.2017	05.08.2020	35 135 137		-	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	USD	1'000.00	22.08.2014	07.08.2020	24 565 112	%	76.810	88.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	07.08.2015	07.08.2020	27 992 503	%	96.080	98.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.08.2015	07.08.2020	28 370 834	%	88.770	97.540	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.08.2016	07.08.2020	32 829 371	%	29.040	95.790	100.000		0.000	Y
Express-Cert. on equities	EUR	1'000.00	08.08.2014	10.08.2020	24 565 276	%	90.730	95.550	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	08.08.2014	10.08.2020	24 565 286	%	103.710	95.330	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	AUD	1'000.00	10.08.2015	10.08.2020	28 781 927	%	98.730	88.840	101.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	09.08.2016	10.08.2020	33 244 960		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 2.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	10.08.2016	10.08.2020	33 244 798		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 11.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.24%	USD	1'000.00	10.08.2017	10.08.2020	37 644 093		-	95.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.08.2017	10.08.2020	37 420 968	%	83.200	100.000	100.000		0.000	Y
Express-Cert. on Basket	USD	1'000.00	22.08.2014	11.08.2020	24 565 138	%	85.330	88.230	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	13.08.2014	13.08.2020	24 565 283	%	96.940	95.330	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Banco Santander	EUR	1'000.00	13.08.2014	13.08.2020	24 565 282	%	72.430	95.270	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	50'000.00	06.08.2015	13.08.2020	28 781 863	%	98.780	91.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Saint-Gobain	USD	1'000.00	13.02.2017	13.08.2020	35 327 929	%	100.810	94.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Cie de Saint-Gobain	EUR	1'000.00	13.02.2017	13.08.2020	35 327 930	%	100.760	100.000	100.000		0.000	N
Reverse Convertible on Equities 15.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.796%	USD	1'000.00	15.06.2017	13.08.2020	36 786 530		-	94.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.07.2017	14.08.2020	37 420 811	%	96.280	99.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.08.2017	17.08.2020	37 643 864	%	94.800	95.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.08.2017	17.08.2020	37 643 863	%	93.930	95.070	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	17.08.2017	17.08.2020	37 643 870	%	95.050	90.260	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.08.2017	17.08.2020	37 643 954	%	92.420	95.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.08.2017	17.08.2020	37 643 966	%	99.130	95.120	100.000		0.000	Y
Structured Note on Basket	GBP	1'000.00	25.08.2015	18.08.2020	28 370 974	%	103.290	78.080	85.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 15.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.902%	USD	1'000.00	28.07.2016	18.08.2020	32 829 616		-	95.580	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	19.08.2014	19.08.2020	24 565 270	%	98.380	87.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Michael Kors	USD	1'000.00	19.08.2016	19.08.2020	33 597 426	%	112.190	95.980	100.000		0.000	Y
Express Certificate on REPSOL	EUR	1'000.00	22.08.2014	21.08.2020	24 565 335	%	81.040	95.560	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	21.08.2015	21.08.2020	28 781 986	%	100.730	92.880	101.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	21.08.2017	21.08.2020	37 643 994	%	100.030	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	24.08.2015	24.08.2020	28 782 016	%	100.040	92.560	101.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.152%	USD	1'000.00	19.08.2016	24.08.2020	33 244 728		-	96.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 15.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.525%	USD	1'000.00	23.08.2016	24.08.2020	33 244 846		-	95.680	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	24.08.2017	24.08.2020	37 749 670	%	98.920	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 22.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.31%	USD	1'000.00	24.08.2017	24.08.2020	37 749 508		-	95.180	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	GBP	1'000.00	25.02.2015	25.08.2020	26 674 673	%	109.120	91.640	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	EUR	1'000.00	25.08.2017	25.08.2020	37 153 961	%	93.600	90.000	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Valeo	EUR	1'000.00	25.08.2017	25.08.2020	37 749 523	%	102.270	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Funds	EUR	1'000.00	25.08.2017	25.08.2020	37 153 730	%	92.660	90.000	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.08.2017	25.08.2020	37 153 728	%	94.320	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.08.2017	25.08.2020	37 153 727	%	96.380	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 24.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.743%	EUR	1'000.00	28.08.2015	28.08.2020	29 348 045		-	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 24.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.977%	USD	1'000.00	28.08.2015	28.08.2020	29 348 046		-	92.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 24.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.743%	EUR	1'000.00	28.08.2015	28.08.2020	29 348 047		-	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 24.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.736%	EUR	1'000.00	28.08.2015	28.08.2020	29 348 048		-	98.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 24.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.977%	USD	1'000.00	28.08.2015	28.08.2020	29 348 049		-	92.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 24.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.736%	EUR	1'000.00	28.08.2015	28.08.2020	29 348 051		-	98.170	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 24.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.736%	EUR	1'000.00	28.08.2015	28.08.2020	29 348 050		-	98.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Index-Basket 23.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.91%	CAD	1'000.00	28.08.2015	28.08.2020	28 782 034		-	94.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.20%	USD	1'000.00	31.07.2017	28.08.2020	37 420 886		-	94.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.08.2016	31.08.2020	33 597 567	%	63.720	95.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.60%	USD	1'000.00	31.08.2016	31.08.2020	33 597 568		-	95.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	31.08.2017	31.08.2020	30 041 325		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	25.08.2015	01.09.2020	28 370 964	%	101.330	91.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.08.2016	01.09.2020	33 245 058	%	17.430	95.670	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.884%	GBP	1'000.00	01.09.2016	01.09.2020	33 244 970		-	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.09.2017	01.09.2020	37 749 526	%	96.060	95.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	01.09.2017	01.09.2020	37 749 499	%	95.300	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	01.09.2017	01.09.2020	37 644 113	%	90.410	98.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	01.09.2017	01.09.2020	37 644 112	%	95.530	98.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.042%	USD	1'000.00	02.09.2015	02.09.2020	29 348 070		-	92.356	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Societe Generale	USD	500.00	10.07.2017	02.09.2020	37 046 852	%	93.500	94.630	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices	GBP	1'000.00	03.09.2014	03.09.2020	24 205 096	%	90.600	88.330	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	03.09.2014	03.09.2020	24 565 076	%	88.470	88.540	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Equities 2.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.456%	EUR	1'000.00	04.09.2014	04.09.2020	24 565 205		-	96.470	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	CHF	1'000.00	04.09.2014	04.09.2020	24 205 105	%	86.650	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	07.09.2017	07.09.2020	37 749 843	%	100.280	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	07.09.2017	07.09.2020	37 749 844	%	99.990	98.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	07.09.2017	07.09.2020	37 749 842	%	100.510	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	08.09.2014	08.09.2020	24 565 510	%	75.180	96.240	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities 23.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	08.09.2014	08.09.2020	24 565 511		-	88.850	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	GBP	1'000.00	08.09.2014	08.09.2020	24 565 512	%	86.070	88.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	08.09.2017	08.09.2020	37 749 813	%	102.010	95.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	08.09.2017	08.09.2020	37 749 841	%	100.570	95.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 8.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.009%	GBP	1'000.00	10.09.2015	10.09.2020	29 348 061		-	92.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.07.2017	10.09.2020	37 046 879	%	94.550	99.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BP Rg	GBP	1'000.00	14.07.2017	10.09.2020	37 153 783	%	102.230	97.490	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Indices 8.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.63%	EUR	1'000.00	11.09.2014	11.09.2020	24 565 572		-	96.470	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Funds	USD	1'000.00	23.09.2014	11.09.2020	24 565 433	%	64.190	88.910	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CSOP FTSE HKD ETF	USD	1'000.00	14.09.2015	14.09.2020	29 348 108	%	153.520	92.370	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on CSOP FTSE HKD ETF	EUR	1'000.00	14.09.2015	14.09.2020	29 348 109	%	147.980	98.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.922%	GBP	1'000.00	14.09.2016	14.09.2020	33 597 724		-	98.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 9.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.849%	USD	1'000.00	14.09.2016	14.09.2020	33 597 535		-	95.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 22.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	13.09.2017	14.09.2020	38 126 826		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	23.09.2014	15.09.2020	24 565 432	%	84.080	88.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	15.09.2015	15.09.2020	29 348 119	%	101.860	92.730	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Euro Stoxx 50-Index 13.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.675%	EUR	1'000.00	15.09.2015	15.09.2020	29 348 100		-	98.120	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 13.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.419%	USD	1'000.00	15.09.2017	15.09.2020	37 749 991		-	95.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.09.2017	15.09.2020	38 126 604	%	94.400	95.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.549%	USD	1'000.00	15.09.2017	15.09.2020	38 126 794		-	95.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.09.2017	15.09.2020	37 749 769	%	86.640	95.210	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	16.09.2015	16.09.2020	29 348 098	%	70.540	92.640	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.09.2016	16.09.2020	33 597 830	%	51.780	95.530	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Equities	EUR	1'000.00	17.09.2014	17.09.2020	24 565 651	%	92.970	96.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.09.2014	17.09.2020	24 205 146	%	70.690	96.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 15.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.323%	USD	1'000.00	18.09.2014	18.09.2020	24 565 438		-	88.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	18.09.2014	18.09.2020	24 565 109	%	91.500	88.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.09.2017	18.09.2020	38 126 829	%	94.050	95.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.09.2017	18.09.2020	38 126 828	%	93.070	95.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.09.2017	18.09.2020	37 749 992	%	98.960	95.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.497% 21.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	16.09.2016	21.09.2020	33 597 429		-	95.480	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	21.09.2017	21.09.2020	37 643 904	%	96.420	85.660	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	21.09.2017	21.09.2020	38 126 710	%	99.100	95.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.09.2017	21.09.2020	38 126 752	%	96.450	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.09.2017	21.09.2020	38 126 748	%	98.970	95.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.572%	USD	1'000.00	22.09.2016	22.09.2020	33 597 608		-	95.720	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Indices	CHF	1'000.00	19.09.2017	22.09.2020	38 126 870	%	98.250	90.000	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	30.09.2014	23.09.2020	24 565 736	%	88.110	96.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.09.2014	24.09.2020	24 565 707	%	72.730	96.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on REPSOL	EUR	1'000.00	24.09.2014	24.09.2020	24 565 706	%	85.330	96.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 24.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.11%	USD	1'000.00	28.09.2015	28.09.2020	27 992 748		-	92.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.603%	GBP	1'000.00	28.09.2016	28.09.2020	33 597 726		-	97.990	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 27.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	28.09.2016	28.09.2020	33 851 153		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.725%	USD	1'000.00	28.09.2016	28.09.2020	33 851 355		-	95.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.03.2017	28.09.2020	35 550 665	%	98.020	93.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.09.2017	28.09.2020	38 310 118	%	80.260	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.09.2017	28.09.2020	38 126 970	%	86.770	94.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	28.09.2017	28.09.2020	38 126 906		-	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	28.09.2017	28.09.2020	38 126 940	%	90.910	90.240	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	28.09.2017	28.09.2020	38 310 116	%	73.730	97.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	29.09.2014	29.09.2020	24 565 580	%	95.000	87.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	29.09.2014	29.09.2020	24 565 581	%	113.270	87.610	100.000		0.000	Y
17.5 % Protection Participation on Funds	USD	1'000.00	29.09.2017	29.09.2020	38 310 054	%	97.940	85.540	90.000		0.000	Y
3.5 % Protection Participation on Funds	USD	1'000.00	29.09.2017	29.09.2020	38 310 049	%	94.780	85.310	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 29.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.787%	GBP	1'000.00	30.09.2014	30.09.2020	24 565 716		-	87.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 21.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.825%	JPY	100'000.00	30.09.2015	30.09.2020	27 992 708		-	99.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 20.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.205%	GBP	1'000.00	30.09.2015	30.09.2020	27 992 725		-	92.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 20.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.01%	USD	1'000.00	30.09.2015	30.09.2020	29 348 143		-	92.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	GBP	1'000.00	01.10.2014	01.10.2020	24 565 494	%	96.430	87.760	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Contingent Capital Protected-Cert. Credit linked on Bank of Ireland	EUR	1'000.00	05.09.2014	02.10.2020	24 565 119	%	95.960	87.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 29.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.099%	USD	1'000.00	02.10.2014	02.10.2020	24 205 277		-	88.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 29.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.659%	GBP	1'000.00	06.10.2014	02.10.2020	25 444 853		-	87.880	100.000		0.000	Y
Contingent Capital Protected Cert. with Reference Bond	EUR	1'000.00	08.08.2014	05.10.2020	24 565 200	%	94.020	95.210	100.000		0.000	Y
Structured Note on Equities	EUR	1'000.00	28.10.2014	05.10.2020	24 565 662	%	87.690	86.130	100.000		0.000	Y
Structured Note Credit Linked on Basket floating rate	EUR	1'000.00	28.10.2014	05.10.2020	24 565 663	%	82.780	81.820	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Delta Lloyd 2.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	05.10.2016	05.10.2020	33 851 086		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.12.2016	05.10.2020	34 765 819	%	90.190	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	01.09.2017	05.10.2020	37 749 628	%	90.240	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	01.09.2017	05.10.2020	37 749 629	%	100.810	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	01.09.2017	05.10.2020	37 749 627	%	100.810	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on EDF	USD	1'000.00	05.10.2017	05.10.2020	38 309 958	%	94.500	94.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTXBnk EUR P	EUR	100.00	05.10.2017	05.10.2020	37 749 751	CHF	113.510	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Societe Generale	USD	1'000.00	05.10.2017	05.10.2020	38 309 960	%	91.980	94.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.10.2017	05.10.2020	38 309 997	%	94.970	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	05.10.2017	05.10.2020	38 309 992	%	97.340	94.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	GBP	1'000.00	06.10.2014	06.10.2020	24 205 297	%	95.780	88.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	06.10.2014	06.10.2020	24 205 282	%	96.930	88.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	10.10.2014	06.10.2020	25 444 871	%	101.510	88.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 5.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.661%	USD	1'000.00	10.10.2014	06.10.2020	25 444 991		-	87.990	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	14.10.2014	06.10.2020	24 205 299	%	91.300	88.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 5.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.803%	USD	1'000.00	14.10.2014	06.10.2020	24 205 300		-	88.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	17.10.2014	06.10.2020	24 565 649	%	82.290	88.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.10.2017	06.10.2020	37 421 041	%	92.380	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.10.2017	06.10.2020	38 310 046	%	95.500	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	EUR	1'000.00	06.10.2017	06.10.2020	37 644 108	%	94.170	90.000	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	06.10.2017	06.10.2020	37 749 887	%	91.050	97.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 4.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.262%	EUR	1'000.00	07.10.2015	07.10.2020	28 782 089		-	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 6.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.13%	USD	1'000.00	08.10.2015	08.10.2020	29 348 111		-	93.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Banco Santander	EUR	1'000.00	09.10.2014	09.10.2020	25 444 964	%	91.910	96.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.10.2017	12.10.2020	38 310 256	%	93.070	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.10.2017	12.10.2020	30 041 352	%	99.080	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Credit Agricole 12.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.128%	EUR	1'000.00	13.10.2014	13.10.2020	25 444 972		-	96.700	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.10.2017	13.10.2020	38 310 033	%	94.410	94.760	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	13.10.2017	13.10.2020	38 486 141	%	95.120	90.000	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	15.10.2014	15.10.2020	24 205 354	%	96.500	89.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	15.10.2014	15.10.2020	24 205 353	%	98.620	89.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 13.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.396%	EUR	1'000.00	15.10.2015	15.10.2020	28 782 097		-	98.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.10.2017	15.10.2020	38 310 264	%	94.140	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.10.2014	16.10.2020	24 205 336	%	71.620	96.590	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.10.2014	16.10.2020	25 445 144	%	73.020	88.120	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Currencies	USD	1'000.00	20.10.2017	16.10.2020	38 486 189	%	96.200	94.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.318%	EUR	1'000.00	17.10.2014	19.10.2020	24 565 211		-	95.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.10.2017	19.10.2020	38 310 045	%	98.610	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.10.2017	19.10.2020	38 310 044	%	94.560	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	19.10.2017	19.10.2020	30 041 358	%	98.260	94.650	100.000		0.000	Y
Protection Participation on S&P 500 30.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	17.10.2014	20.10.2020	25 445 212		-	84.790	95.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Repsol 19.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	20.10.2016	20.10.2020	34 080 783		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	CHF	1'000.00	20.10.2017	20.10.2020	38 485 560	%	96.170	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	21.10.2014	21.10.2020	24 205 380	%	95.700	89.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	23.10.2014	23.10.2020	25 445 248	%	97.370	90.540	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 21.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.508%	AUD	1'000.00	23.10.2015	23.10.2020	28 782 179		-	88.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 24.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.172%	USD	1'000.00	26.10.2015	26.10.2020	28 782 190		-	93.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	26.10.2016	26.10.2020	33 851 322		-	95.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	12.10.2017	26.10.2020	38 310 261	%	91.900	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on PIMCO Global Investors	USD	1'000.00	24.10.2017	26.10.2020	38 486 269	%	96.510	94.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.10.2017	26.10.2020	38 486 204	%	92.780	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.10.2017	26.10.2020	30 041 378	%	97.380	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	26.10.2017	26.10.2020	38 485 643	%	96.220	94.510	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on TevaPharmInd Sp ADR	USD	1'000.00	26.10.2017	26.10.2020	38 485 712	%	111.190	94.540	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.10.2017	26.10.2020	38 485 676	%	92.180	100.000	100.000		0.000	Y
7.4 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.10.2017	26.10.2020	38 486 161	%	99.550	100.000	100.000		0.000	N
Reverse Convertible on Funds	GBP	1'000.00	27.10.2014	27.10.2020	25 445 285	%	110.730	89.580	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	GBP	1'000.00	03.11.2014	27.10.2020	25 445 095	%	98.310	89.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.10.2017	27.10.2020	38 486 205	%	99.030	94.610	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	27.10.2017	27.10.2020	38 485 737	%	97.700	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities 24.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	GBP	1'000.00	11.11.2015	28.10.2020	28 782 207		-	84.000	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 27.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.357%	EUR	1'000.00	29.10.2015	29.10.2020	28 782 177		-	98.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.10.2017	30.10.2020	38 486 321	%	98.670	94.480	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	CHF	1'000.00	02.11.2016	02.11.2020	34 080 752	%	99.460	90.000	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 31.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.875%	USD	1'000.00	02.11.2016	02.11.2020	34 080 462		-	95.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.10.2017	02.11.2020	38 486 348	%	101.510	94.360	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	02.11.2017	02.11.2020	38 485 963		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.11.2014	03.11.2020	25 822 890	%	96.050	89.740	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.11.2017	03.11.2020	38 485 581	%	98.200	100.000	100.000		0.000	Y
4.5 % Underlying Tracker on CS Group N	EUR	1'000.00	03.11.2017	03.11.2020	38 486 368	%	97.590	100.000	100.000		0.000	N
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 3.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.376%	EUR	1'000.00	04.11.2015	04.11.2020	28 782 208		-	98.370	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Funds	USD	1'000.00	30.10.2017	04.11.2020	38 486 324	%	101.320	94.460	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on STXE6 EUR P	EUR	1'000.00	05.11.2014	05.11.2020	24 205 469	%	122.360	96.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	GBP	1'000.00	14.11.2014	05.11.2020	25 445 136	%	100.590	89.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	14.11.2014	05.11.2020	25 445 137	%	96.240	89.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	06.11.2014	06.11.2020	25 822 912	%	53.580	89.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 9.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.311%	USD	1'000.00	04.11.2016	09.11.2020	34 080 792		-	95.210	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.79%	USD	1'000.00	04.11.2016	09.11.2020	34 080 811		-	95.320	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Indices	USD	1'000.00	07.11.2017	09.11.2020	38 486 384	%	97.010	94.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	10.11.2017	10.11.2020	38 486 410	%	97.400	94.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.11.2014	11.11.2020	25 923 953	%	3.730	96.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.495%	USD	1'000.00	08.11.2016	12.11.2020	34 080 845		-	95.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.11.2017	12.11.2020	38 486 101	%	85.370	94.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	13.11.2014	13.11.2020	24 205 502	%	109.530	89.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	13.11.2015	13.11.2020	30 040 768		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 11.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.728% 11.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	16.11.2015	16.11.2020	30 040 781		-	92.050	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	16.11.2016	16.11.2020	34 443 614	%	80.890	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BMW 14.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	16.11.2016	16.11.2020	34 081 000		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	16.11.2016	16.11.2020	34 443 616		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	16.11.2016	16.11.2020	34 443 613		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	16.11.2016	16.11.2020	34 443 615		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	CHF	1'000.00	16.11.2017	16.11.2020	38 485 817	%	95.410	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.11.2017	16.11.2020	38 485 819	%	99.560	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on iShs FTSE 100 GBP	GBP	1'000.00	17.11.2014	17.11.2020	25 823 245	%	102.820	89.640	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.11.2017	17.11.2020	38 310 136	%	97.940	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.11.2017	17.11.2020	38 486 424	%	96.510	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	EUR	1'000.00	17.11.2017	17.11.2020	38 310 135	%	98.100	90.000	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	18.11.2014	18.11.2020	25 923 951	%	89.180	89.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 15.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.176%	USD	1'000.00	18.11.2016	18.11.2020	34 443 650		-	94.400	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	USD	1'000.00	19.11.2014	19.11.2020	25 822 918	%	125.240	88.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	20.11.2017	20.11.2020	39 034 378	%	98.030	94.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	20.11.2020	39 034 365	%	85.950	94.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.737%	USD	1'000.00	30.11.2016	23.11.2020	34 443 882		-	93.990	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.07.2017	23.11.2020	37 047 033	%	56.240	94.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.11.2017	23.11.2020	39 034 541	%	98.300	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.11.2017	23.11.2020	39 034 507	%	97.960	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.11.2017	23.11.2020	39 034 326	%	97.170	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.11.2017	23.11.2020	39 034 327	%	98.080	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 22.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.583%	EUR	1'000.00	24.11.2015	24.11.2020	30 041 148		-	98.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 22.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.583%	EUR	1'000.00	24.11.2015	24.11.2020	30 041 149		-	98.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 22.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.078%	USD	1'000.00	24.11.2015	24.11.2020	30 041 150		-	92.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	24.11.2016	24.11.2020	34 540 751	%	96.310	96.630	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	24.11.2017	24.11.2020	39 034 321	%	98.850	94.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 26.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.335%	GBP	1'000.00	26.11.2014	26.11.2020	25 924 071		-	89.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 23.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.487%	EUR	1'000.00	26.11.2015	26.11.2020	28 782 274		-	98.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.11.2014	27.11.2020	25 924 063	%	69.370	96.990	100.000		0.000	Y
Structured Note on Equities	GBP	1'000.00	27.11.2014	27.11.2020	25 924 064	%	93.020	90.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.11.2017	27.11.2020	39 034 555	%	96.320	94.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.11.2014	30.11.2020	24 205 318	%	69.710	96.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.11.2017	30.11.2020	39 034 377	%	99.340	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.11.2017	30.11.2020	39 034 482	%	97.170	94.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 29.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.275%	USD	1'000.00	01.12.2014	01.12.2020	25 924 011		-	89.110	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	07.12.2015	01.12.2020	29 348 199	%	103.920	92.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.276%	USD	1'000.00	01.12.2016	01.12.2020	34 443 825		-	93.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	01.12.2017	01.12.2020	39 034 437	%	97.160	94.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	CHF	1'000.00	01.12.2017	01.12.2020	39 034 501	%	95.920	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.12.2017	01.12.2020	39 164 171	%	90.750	94.180	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	02.12.2014	02.12.2020	25 923 862	%	108.100	89.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 29.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.669%	EUR	1'000.00	02.12.2015	02.12.2020	29 347 795		-	99.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.12.2016	02.12.2020	34 540 824	%	10.310	99.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	03.12.2015	03.12.2020	29 348 220	%	111.370	92.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.12.2017	04.12.2020	39 164 172	%	97.810	94.260	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.12.2017	04.12.2020	39 034 558	%	101.820	94.260	100.000		0.000	Y
Structured Note on Equities	GBP	1'000.00	05.12.2014	07.12.2020	25 924 103	%	95.030	90.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.675%	EUR	1'000.00	07.12.2015	07.12.2020	30 041 176		-	99.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 2.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.656%	EUR	1'000.00	07.12.2015	07.12.2020	30 041 173		-	99.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 4.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.12.2016	07.12.2020	34 540 878		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	07.12.2017	07.12.2020	39 034 323	%	96.290	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.12.2014	08.12.2020	25 924 042	%	91.880	89.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	08.12.2016	08.12.2020	34 540 823		-	99.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	08.12.2017	08.12.2020	39 164 218	%	101.130	94.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Commodities	USD	1'000.00	08.12.2017	08.12.2020	39 164 000	%	100.160	94.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.12.2017	08.12.2020	39 164 001	%	97.490	94.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on REPSOL	USD	1'000.00	10.12.2014	10.12.2020	25 822 968	%	80.730	89.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on REPSOL	EUR	1'000.00	10.12.2014	10.12.2020	25 822 969	%	81.110	97.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.12.2014	10.12.2020	25 822 965	%	69.910	97.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.06.2015	11.12.2020	28 370 790	%	115.730	90.210	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	11.12.2017	11.12.2020	39 164 234	%	96.260	97.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	11.12.2017	11.12.2020	39 164 233	%	103.180	97.150	100.000		0.000	Y
4.6 % Reverse Convertible on Indices 12.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	14.12.2016	14.12.2020	34 540 992		-	100.000	100.000	12.06. 12.12.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 12.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	14.12.2016	14.12.2020	34 765 662		-	99.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.12.2014	15.12.2020	25 822 998	%	65.680	96.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	09.12.2016	16.12.2020	34 765 653		-	99.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.12.2015	17.12.2020	30 041 151	%	98.840	92.420	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	EUR	1'000.00	17.06.2016	17.12.2020	32 339 591	%	109.110	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible 2015-18.12.20 on Basket	EUR	1'000.00	18.12.2015	18.12.2020	29 347 829	%	113.060	98.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 16.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.717%	USD	1'000.00	12.12.2016	18.12.2020	34 540 975		-	93.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	24.11.2017	18.12.2020	38 486 493	%	98.550	94.190	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	18.12.2017	18.12.2020	39 164 228	%	99.440	93.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 17.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.939%	USD	1'000.00	21.12.2015	21.12.2020	29 348 226		-	92.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.12.2017	21.12.2020	39 163 987	%	100.690	94.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.12.2017	21.12.2020	39 163 988	%	95.540	94.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	20.12.2017	21.12.2020	39 164 249	%	99.120	93.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	20.12.2017	21.12.2020	39 164 248	%	96.880	93.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	20.12.2017	21.12.2020	39 164 247	%	98.720	93.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.12.2017	21.12.2020	39 164 147	%	98.460	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.12.2017	21.12.2020	39 164 144	%	94.820	93.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.12.2017	21.12.2020	39 164 146	%	94.910	93.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.12.2017	21.12.2020	39 164 145	%	94.440	93.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.12.2017	21.12.2020	39 164 130	%	98.860	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 20.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.411% 20.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	22.12.2014	22.12.2020	25 923 863		-	89.580	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTXSD30 EUR P	GBP	1'000.00	22.12.2014	22.12.2020	25 924 088	%	96.750	90.860	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Mket Vect Gld Min	USD	1'000.00	22.12.2015	22.12.2020	30 041 162	%	121.080	92.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	CHF	1'000.00	22.12.2017	22.12.2020	39 164 258	%	95.870	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 22.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.269%	EUR	1'000.00	23.12.2014	23.12.2020	25 924 135		-	97.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 21.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.561%	USD	1'000.00	23.12.2014	23.12.2020	25 924 182		-	89.640	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.12.2014	24.12.2020	25 823 021	%	65.950	96.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.12.2017	24.12.2020	39 164 151	%	99.000	93.970	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Funds	USD	1'000.00	22.12.2017	28.12.2020	39 164 091	%	97.660	89.280	95.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	28.12.2017	28.12.2020	39 164 277	%	98.100	93.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	28.12.2017	28.12.2020	39 164 276	%	97.890	93.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	28.12.2017	28.12.2020	39 164 280	%	99.450	93.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 21.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.341%	GBP	1'000.00	29.12.2014	29.12.2020	25 924 114		-	90.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.07.2017	29.12.2020	37 420 838	%	96.570	94.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 22.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	GBP	1'000.00	30.12.2015	30.12.2020	30 497 731		-	93.010	100.000		0.000	Y
Structured Note on Equities	EUR	1'000.00	06.10.2014	31.12.2020	25 444 974	%	92.800	91.160	100.000		0.000	Y
Structured Note Credit Linked to Raiffeisen	CHF	1'000.00	03.11.2014	04.01.2021	25 445 193	%	99.770	98.890	100.000	28.12.	5.000	N
Structured Note on Equities	EUR	1'000.00	10.11.2014	04.01.2021	25 823 230	%	93.590	88.210	100.000		0.000	Y
Structured Note on Equities	EUR	1'000.00	15.12.2014	04.01.2021	25 924 162	%	93.280	94.100	100.000		0.000	Y
Structured Note Credit Linked on Dexia Credit Local	EUR	1'000.00	19.12.2014	04.01.2021	25 924 007	%	93.540	86.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Daimler N	EUR	1'000.00	04.01.2016	04.01.2021	30 497 868	%	89.080	98.370	100.000		0.000	Y
Structured Note on Equities	EUR	1'000.00	14.11.2014	06.01.2021	25 445 148	%	86.020	90.030	95.000		0.000	Y
Structured Note on Equities	EUR	1'000.00	14.11.2014	06.01.2021	25 445 149	%	90.330	94.770	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Barclays Rg	USD	1'000.00	07.12.2017	06.01.2021	39 163 985	%	99.510	93.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	07.01.2015	07.01.2021	25 924 170	%	130.280	89.110	100.000		0.000	Y
Structured Note Credit Linked on Raiffeisen Bank	USD	1'000.00	18.11.2015	11.01.2021	30 040 764	%	104.880	91.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on NATIXIS 9.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	15.01.2016	11.01.2021	30 497 905		-	98.710	100.000		0.000	Y
8.1 % Structured Note on Rallye SA	EUR	1'000.00	25.11.2016	11.01.2021	34 540 821	%	107.500	100.000	100.000	11.01.	11.090	N
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	12.01.2015	12.01.2021	25 923 890	%	95.880	89.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 10.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.606%	USD	1'000.00	12.01.2016	12.01.2021	29 347 884		-	91.960	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SAP	EUR	83.66	11.01.2017	13.01.2021	34 902 310	CHF	110.500	99.960	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Daimler N	EUR	72.04	11.01.2017	13.01.2021	34 902 308	CHF	88.670	99.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.01.2015	14.01.2021	25 823 067	%	90.620	97.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Banco Santander	EUR	1'000.00	14.01.2015	14.01.2021	25 823 068	%	94.730	97.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Telefonica	USD	1'000.00	14.01.2015	14.01.2021	25 823 069	%	73.880	89.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 12.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.689%	GBP	1'000.00	14.01.2015	14.01.2021	25 924 270		-	91.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.685%	EUR	1'000.00	14.01.2016	14.01.2021	30 497 899		-	98.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 16.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.698%	EUR	1'000.00	18.01.2016	18.01.2021	29 347 950		-	98.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 16.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.685%	EUR	1'000.00	19.01.2016	19.01.2021	29 347 957		-	98.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 16.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.01.2016	19.01.2021	29 347 958		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 16.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.01.2016	19.01.2021	29 347 963		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 16.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.697%	EUR	1'000.00	19.01.2016	19.01.2021	29 347 961		-	98.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 17.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.492%	USD	1'000.00	19.01.2016	19.01.2021	29 347 962		-	92.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 16.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.763%	GBP	1'000.00	03.01.2017	19.01.2021	34 902 263		-	96.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	19.01.2017	19.01.2021	34 902 302	%	103.370	93.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.01.2015	20.01.2021	25 823 025	%	108.180	96.980	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SPDR S&P OilGs ExPr	USD	1'000.00	21.01.2016	21.01.2021	30 497 855	%	110.820	93.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 24.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.794%	USD	1'000.00	26.01.2015	26.01.2021	25 924 212		-	91.670	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	27.01.2015	27.01.2021	25 823 133	%	129.500	91.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	27.01.2015	27.01.2021	26 674 597	%	110.630	92.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.01.2017	28.01.2021	35 327 559	%	58.300	93.180	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Axa 27.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.459%	EUR	1'000.00	22.01.2016	29.01.2021	29 347 937		-	98.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on USD/EUR 26.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.70%	USD	1'000.00	29.01.2016	29.01.2021	30 498 015		-	93.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 26.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.819%	USD	1'000.00	29.01.2016	29.01.2021	29 348 035		-	93.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.02.2017	01.02.2021	35 135 464	%	19.130	92.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	02.02.2016	02.02.2021	31 185 261	%	104.910	99.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	02.02.2017	02.02.2021	35 135 449	%	42.330	96.250	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 2.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.953%	USD	1'000.00	04.02.2016	04.02.2021	30 497 927		-	93.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Kering	EUR	1'000.00	08.02.2016	08.02.2021	31 185 285	%	105.180	99.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BMW	EUR	1'000.00	08.02.2016	08.02.2021	31 185 284	%	106.070	99.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Accor	EUR	1'000.00	08.02.2016	08.02.2021	31 185 283	%	108.600	99.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 6.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.376%	USD	1'000.00	08.02.2016	08.02.2021	30 497 931		-	93.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 4.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.92%	USD	1'000.00	08.02.2017	08.02.2021	35 327 968		-	92.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 4.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.215%	USD	1'000.00	08.02.2017	08.02.2021	35 327 945		-	93.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 4.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.959%	USD	1'000.00	08.02.2017	08.02.2021	35 327 852		-	92.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 4.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.705%	EUR	1'000.00	08.02.2017	08.02.2021	35 327 853		-	99.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 7.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.498%	EUR	1'000.00	09.02.2015	09.02.2021	25 823 193		-	97.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 7.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.302%	USD	1'000.00	09.02.2015	09.02.2021	25 823 191		-	91.180	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on China Vanke -H-	HKD	10'000.00	10.02.2015	10.02.2021	25 823 199	%	155.560	92.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.08.2015	10.02.2021	28 781 839	%	105.440	90.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	16.02.2015	16.02.2021	26 674 537	%	117.230	91.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 14.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.461%	GBP	1'000.00	20.02.2015	17.02.2021	26 674 574		-	91.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 14.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.461%	GBP	1'000.00	20.02.2015	17.02.2021	26 674 575		-	91.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Hugo Boss N	EUR	1'000.00	18.02.2016	18.02.2021	30 040 876	%	109.080	99.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on S&P GSCI Crd OilER 9.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.698%	USD	1'000.00	19.02.2016	19.02.2021	31 185 314		-	94.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.11.2017	19.02.2021	39 034 301	%	98.160	93.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	23.02.2017	23.02.2021	35 447 851	%	17.590	96.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.02.2017	23.02.2021	35 447 853	%	28.760	92.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.02.2017	23.02.2021	35 447 873	%	77.800	92.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.02.2017	23.02.2021	35 447 874	%	83.180	92.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.02.2015	25.02.2021	25 924 320	%	21.300	97.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 24.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.071%	USD	1'000.00	25.02.2016	25.02.2021	31 524 355		-	94.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	SEK	10'000.00	25.02.2016	25.02.2021	31 524 334	%	144.810	98.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	27.02.2015	26.02.2021	26 674 797	%	118.000	89.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	03.03.2015	26.02.2021	26 674 549	%	92.800	89.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.072%	USD	1'000.00	27.02.2017	26.02.2021	35 447 821		-	92.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.817%	GBP	1'000.00	01.03.2016	01.03.2021	31 524 374		-	95.150	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 27.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.857%	GBP	1'000.00	01.03.2016	01.03.2021	30 497 926		-	95.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.623%	USD	1'000.00	05.09.2017	05.03.2021	37 749 782		-	94.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.623%	USD	1'000.00	05.09.2017	05.03.2021	37 749 781		-	94.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 6.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.03.2017	08.03.2021	35 448 167		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 7.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.285%	GBP	1'000.00	04.03.2015	09.03.2021	26 674 730		-	90.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	09.03.2015	09.03.2021	26 673 911		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	09.03.2015	09.03.2021	27 214 260	%	67.400	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 7.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.577%	USD	1'000.00	20.03.2015	09.03.2021	26 674 550		-	89.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	20.03.2015	09.03.2021	26 674 818	%	81.570	89.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTXBnk EUR P	EUR	1'000.00	09.03.2016	09.03.2021	30 041 007	%	104.850	99.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.03.2017	09.03.2021	35 550 937	%	41.790	92.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.03.2015	11.03.2021	26 673 921	%	77.370	97.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.03.2015	12.03.2021	26 673 907	%	53.560	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 13.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	15.03.2017	15.03.2021	35 550 556		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	17.03.2015	17.03.2021	26 673 929	%	99.500	97.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.03.2015	17.03.2021	25 823 175	%	90.170	97.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 15.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.038%	GBP	1'000.00	26.03.2015	17.03.2021	26 674 755		-	90.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.03.2017	17.03.2021	35 550 956	%	101.290	92.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	17.03.2017	17.03.2021	35 550 958	%	97.220	92.020	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Shares-Basket	EUR	1'000.00	20.03.2015	19.03.2021	27 339 374	%	98.240	92.970	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 20.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.602%	GBP	1'000.00	22.03.2016	22.03.2021	31 185 266		-	94.580	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 20.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.746%	EUR	1'000.00	22.03.2016	22.03.2021	29 348 004		-	98.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 20.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.241% 20.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	22.03.2017	22.03.2021	35 914 177		-	92.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.03.2017	22.03.2021	35 550 960	%	96.880	92.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 21.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.601%	EUR	1'000.00	27.03.2015	23.03.2021	26 674 759		-	97.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 21.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	23.03.2016	23.03.2021	31 524 552		-	93.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 21.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.783%	USD	1'000.00	23.03.2016	23.03.2021	31 524 550		-	93.240	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Funds	USD	1'000.00	17.03.2016	24.03.2021	31 524 522	%	125.850	92.700	100.000		0.000	Y
Express-Cert. on Index-Basket	USD	1'000.00	25.03.2015	25.03.2021	26 674 752	%	97.080	89.640	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	27.03.2017	26.03.2021	35 914 300	%	97.660	92.390	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.198%	EUR	1'000.00	05.04.2016	29.03.2021	31 524 559		-	99.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.781%	GBP	1'000.00	30.03.2015	30.03.2021	27 339 479		-	92.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 28.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.781%	GBP	1'000.00	30.03.2015	30.03.2021	27 339 478		-	92.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 28.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.208%	USD	1'000.00	30.03.2016	30.03.2021	31 185 265		-	93.700	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	02.04.2015	31.03.2021	26 674 040	%	95.440	97.980	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	06.04.2017	06.04.2021	36 170 783	%	100.880	92.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.03.2015	07.04.2021	26 674 786	%	105.770	97.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	07.04.2015	07.04.2021	26 674 769	%	82.550	91.670	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	07.04.2015	07.04.2021	27 339 300	%	74.530	91.670	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	07.04.2015	07.04.2021	27 339 346	%	116.190	98.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	07.04.2015	07.04.2021	26 674 039	%	89.300	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	09.04.2015	09.04.2021	27 339 303	%	98.180	90.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 11.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.003%	GBP	1'000.00	13.04.2015	13.04.2021	26 674 067		-	91.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 11.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.741%	GBP	1'000.00	13.04.2017	13.04.2021	35 551 055		-	97.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.619%	EUR	1'000.00	21.04.2016	14.04.2021	31 524 632		-	99.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 13.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	15.04.2015	15.04.2021	26 674 094		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 13.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	15.04.2015	15.04.2021	26 674 095		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	19.04.2017	19.04.2021	36 171 039	%	93.530	97.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	19.04.2017	19.04.2021	36 171 040	%	91.560	97.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	20.04.2015	20.04.2021	26 674 123	%	116.420	91.670	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 20.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.321%	GBP	1'000.00	20.04.2015	20.04.2021	26 674 122		-	91.670	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	20.04.2015	20.04.2021	26 674 748	%	83.550	91.670	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 20.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.321%	GBP	1'000.00	20.04.2015	20.04.2021	26 674 121		-	91.670	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	20.04.2015	20.04.2021	27 339 317	%	81.050	90.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	20.04.2015	20.04.2021	27 339 310	%	78.450	98.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	21.04.2016	21.04.2021	31 524 664	%	39.350	95.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	26.04.2016	23.04.2021	31 524 625		-	99.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	17.04.2015	26.04.2021	26 673 947	%	99.100	97.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	26.04.2016	26.04.2021	31 185 533	%	105.510	94.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 24.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.364%	EUR	1'000.00	26.04.2016	26.04.2021	31 524 450		-	99.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 24.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.567%	GBP	1'000.00	10.05.2016	26.04.2021	31 524 574		-	94.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	26.04.2017	26.04.2021	36 171 044	%	99.820	97.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	24.04.2015	27.04.2021	27 339 343	%	87.990	91.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.04.2017	27.04.2021	36 171 041	%	103.040	99.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.11.2017	28.04.2021	38 486 263	%	40.670	93.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	29.04.2015	29.04.2021	26 674 157	%	88.470	98.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	30.04.2015	29.04.2021	27 339 340	%	87.230	90.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Vallourec	EUR	1'000.00	06.05.2015	29.04.2021	27 339 705	%	40.330	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Credit Agricole	USD	1'000.00	08.08.2017	29.04.2021	37 420 966	%	97.190	93.670	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.04.2015	30.04.2021	26 674 161	%	91.820	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.04.2015	30.04.2021	26 674 162	%	92.700	98.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.04.2015	30.04.2021	27 339 636	%	45.330	98.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	30.04.2015	30.04.2021	27 339 698	%	105.740	98.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.10.2017	30.04.2021	38 486 110	%	93.820	99.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.272%	USD	1'000.00	03.05.2016	03.05.2021	31 185 548		-	93.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.05.2017	03.05.2021	36 171 308	%	94.440	93.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.11.2017	03.05.2021	38 485 944	%	100.550	93.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 1.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.644%	USD	1'000.00	04.05.2015	04.05.2021	26 674 258		-	90.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Repsol	EUR	1'000.00	04.05.2015	04.05.2021	26 674 210	%	79.740	98.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 3.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	05.05.2015	05.05.2021	26 674 254		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	05.05.2015	05.05.2021	27 991 947	%	84.470	91.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	05.05.2015	05.05.2021	27 339 736	%	95.840	91.240	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Shares-Basket	SEK	10'000.00	05.05.2015	05.05.2021	27 991 968	%	97.500	97.280	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Basket 3.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.093%	GBP	1'000.00	05.05.2015	05.05.2021	26 674 257		-	91.180	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 2.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.834%	EUR	1'000.00	05.05.2017	05.05.2021	36 170 939		-	99.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.05.2017	05.05.2021	36 171 608	%	90.650	93.300	100.000	06.06.	0.660	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.05.2015	06.05.2021	26 674 232	%	36.890	98.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.05.2015	06.05.2021	26 674 231	%	63.370	98.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	08.05.2015	06.05.2021	27 339 639	%	78.370	90.820	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	06.11.2017	06.05.2021	38 485 830	%	103.440	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.04.2015	07.05.2021	26 673 965	%	62.620	97.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.05.2015	07.05.2021	26 674 238	%	66.230	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	07.05.2015	07.05.2021	27 991 986	%	115.830	91.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	13.05.2015	07.05.2021	27 991 972	%	109.070	98.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	13.05.2015	07.05.2021	26 674 272	%	72.110	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	11.05.2015	11.05.2021	26 674 286	%	101.560	90.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	11.05.2015	11.05.2021	26 674 285	%	99.190	90.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.488%	EUR	1'000.00	11.05.2016	11.05.2021	31 185 583		-	99.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.05.2017	12.05.2021	36 170 953	%	104.710	99.680	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.11.2016	17.05.2021	34 081 023	%	77.820	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.05.2015	18.05.2021	26 674 294	%	95.530	97.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.05.2015	18.05.2021	26 674 356	%	55.940	96.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTXBnk EUR P	EUR	1'000.00	18.05.2015	18.05.2021	26 674 295	%	99.810	97.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 16.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.824%	GBP	1'000.00	18.05.2016	18.05.2021	32 339 394		-	95.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Direx Dly Emg MB3X 16.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.723%	USD	1'000.00	19.05.2015	19.05.2021	26 674 407		-	89.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	20.05.2015	20.05.2021	27 339 741	%	57.480	90.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.10.2015	20.05.2021	29 348 256	%	80.940	98.390	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.05.2015	21.05.2021	27 339 619	%	63.630	97.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Repsol	USD	1'000.00	21.05.2015	21.05.2021	26 674 364	%	77.630	89.580	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 22.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.891%	USD	1'000.00	21.05.2015	21.05.2021	26 674 380		-	89.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.05.2017	24.05.2021	36 171 452	%	92.840	93.150	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Japan	USD	1'000.00	24.11.2017	24.05.2021	39 034 322	%	98.370	93.270	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	24.11.2017	24.05.2021	39 034 517	%	109.730	99.900	100.000		0.000	Y
Structured Note on Equities	SEK	10'000.00	26.05.2015	26.05.2021	27 992 766	%	87.560	85.700	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	26.05.2015	26.05.2021	27 992 774	%	102.360	96.990	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on MSCI WORLD INDEX	USD	1'000.00	29.05.2015	28.05.2021	27 992 833	%	111.350	89.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.06.2015	28.05.2021	27 992 851	%	1.450	95.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.06.2016	31.05.2021	32 339 462	%	0.660	99.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 26.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	01.06.2015	01.06.2021	26 674 496		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	JPY	100'000.00	02.06.2016	02.06.2021	32 339 400		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Accor 2.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	02.12.2016	02.06.2021	34 540 664		-	99.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.06.2015	03.06.2021	27 992 067	%	88.830	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	04.06.2015	04.06.2021	27 992 828	%	92.840	96.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.06.2015	04.06.2021	26 674 515	%	83.570	97.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.06.2015	04.06.2021	27 992 846	%	62.710	97.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	08.06.2015	04.06.2021	27 339 680	%	113.250	89.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Suez Env. Cpy	EUR	1'000.00	29.05.2015	07.06.2021	27 992 762	%	85.470	96.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Axa	EUR	1'000.00	29.05.2015	07.06.2021	27 992 763	%	115.560	96.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on CGG	EUR	1'000.00	29.05.2015	07.06.2021	27 992 764	%	1.510	96.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	07.06.2017	07.06.2021	36 786 456	%	84.210	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	22.06.2015	08.06.2021	27 992 101	%	59.600	90.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 7.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.752%	CAD	1'000.00	09.06.2015	09.06.2021	27 992 116		-	91.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	09.06.2015	09.06.2021	27 992 054	%	98.250	96.990	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 7.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.181%	USD	1'000.00	09.06.2016	09.06.2021	31 185 740		-	93.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.568%	USD	1'000.00	09.06.2017	09.06.2021	36 786 491		-	93.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	10.06.2015	10.06.2021	27 339 681	%	86.160	90.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.06.2015	10.06.2021	27 992 921	%	58.320	97.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	10.06.2015	10.06.2021	27 992 069	%	94.780	97.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 8.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	10.06.2015	10.06.2021	27 992 128		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.06.2015	11.06.2021	26 674 489	%	89.570	89.740	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	11.06.2015	11.06.2021	27 992 085	%	94.380	97.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.06.2015	11.06.2021	27 992 083	%	83.440	97.110	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Funds	USD	1'000.00	14.06.2016	14.06.2021	32 338 996	%	93.860	94.070	100.000		0.000	Y
7.23 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	14.06.2016	14.06.2021	32 339 494	%	2.570	96.870	100.000	10.03. 12.06. 12.09. 12.12.	2.750 2.940 2.960 3.080	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	12.06.2015	15.06.2021	27 339 682	%	88.880	95.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 14.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	16.06.2015	16.06.2021	27 992 169		-	99.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 15.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.474%	USD	1'000.00	17.06.2015	17.06.2021	27 992 895		-	88.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.161%	EUR	1'000.00	17.06.2015	17.06.2021	27 992 161		-	96.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 15.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.837%	EUR	1'000.00	17.06.2015	17.06.2021	28 370 872		-	95.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BBVA	EUR	1'000.00	22.06.2015	17.06.2021	27 992 163	%	95.850	95.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.06.2015	18.06.2021	28 370 885	%	85.840	95.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Air Liquide 19.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	21.12.2016	21.06.2021	34 765 707		-	99.640	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.06.2017	21.06.2021	36 786 336	%	93.110	99.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.349%	USD	1'000.00	21.06.2017	21.06.2021	37 046 970		-	93.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.06.2017	21.06.2021	36 786 322	%	106.130	99.640	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.383%	USD	1'000.00	21.06.2017	21.06.2021	37 046 947		-	93.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 20.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.32%	USD	1'000.00	22.06.2015	22.06.2021	27 339 675		-	88.640	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	22.06.2015	22.06.2021	27 339 677	%	102.810	88.640	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTXBnk EUR P	EUR	1'000.00	22.06.2016	22.06.2021	31 524 310	%	104.770	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	23.06.2015	23.06.2021	27 992 899	%	95.960	88.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	23.06.2015	23.06.2021	28 370 862	%	98.830	95.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BBVA	EUR	1'000.00	23.06.2015	23.06.2021	27 992 205	%	91.320	95.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.06.2015	23.06.2021	27 992 195	%	74.010	95.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 22.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	24.06.2015	24.06.2021	27 992 233		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 22.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.00%	EUR	1'000.00	24.06.2015	24.06.2021	27 992 216		-	95.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BBVA	EUR	1'000.00	25.06.2015	25.06.2021	27 992 217	%	92.850	96.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 23.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	25.06.2015	25.06.2021	27 992 245		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	25.06.2015	25.06.2021	27 992 190	%	95.430	95.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	25.06.2015	25.06.2021	28 370 841	%	113.910	89.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 22.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.163%	EUR	1'000.00	30.06.2015	25.06.2021	27 992 258		-	96.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.06.2017	28.06.2021	36 786 267	%	94.820	99.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	GBP	1'000.00	28.12.2017	28.06.2021	39 509 729	%	98.770	96.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	GBP	1'000.00	28.12.2017	28.06.2021	39 509 726	%	99.170	96.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	GBP	1'000.00	28.12.2017	28.06.2021	39 509 730	%	99.450	96.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	29.06.2015	29.06.2021	27 992 218	%	96.460	95.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	29.06.2015	29.06.2021	28 370 853	%	101.570	89.900	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Total 28.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.193%	EUR	1'000.00	23.06.2015	30.06.2021	27 992 131		-	96.180	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	01.07.2015	01.07.2021	27 992 910	%	73.500	88.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Societe Generale	USD	1'000.00	19.10.2017	01.07.2021	38 310 393	%	89.450	93.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	02.07.2015	02.07.2021	27 992 919	%	68.200	89.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	09.07.2015	02.07.2021	27 992 913	%	97.550	88.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 5.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	JPY	100'000.00	05.07.2016	05.07.2021	32 339 629		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	31.05.2017	05.07.2021	36 786 297	%	99.800	99.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.07.2015	06.07.2021	28 370 878	%	95.610	96.222	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.402%	EUR	1'000.00	06.07.2015	06.07.2021	27 992 311		-	96.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	SEK	10'000.00	06.07.2016	06.07.2021	32 339 356	%	88.400	99.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	07.07.2015	07.07.2021	27 992 275	%	96.470	95.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.07.2015	07.07.2021	28 781 788	%	88.690	96.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on EDF 3.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	28.07.2016	07.07.2021	32 829 492		-	100.000	100.000	31.08.	0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	09.07.2015	09.07.2021	28 370 930	%	99.090	88.950	100.000		0.000	Y
Structured Note	EUR	1'000.00	20.05.2016	12.07.2021	32 339 415	%	105.350	90.356	100.000		0.000	Y
Structured Note	CHF	1'000.00	20.05.2016	12.07.2021	32 339 416	%	103.910	90.540	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on EDF 8.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.501%	EUR	1'000.00	12.07.2017	12.07.2021	30 041 296		-	99.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.07.2015	13.07.2021	27 992 876	%	73.910	96.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	13.07.2015	13.07.2021	27 992 312	%	98.450	96.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Sanofi 11.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.613%	EUR	1'000.00	13.01.2017	13.07.2021	34 902 306		-	99.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Repsol	EUR	1'000.00	14.07.2015	14.07.2021	27 992 317	%	98.180	96.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 6.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.259%	EUR	1'000.00	15.07.2015	14.07.2021	28 371 028		-	96.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 12.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	14.07.2016	14.07.2021	32 339 634		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 13.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.191%	GBP	1'000.00	15.07.2015	15.07.2021	28 370 963		-	90.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	15.07.2015	15.07.2021	28 370 958	%	122.430	89.740	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	15.07.2015	15.07.2021	27 992 328	%	98.870	96.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.07.2015	16.07.2021	20 454 952	%	4.680	95.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.07.2015	16.07.2021	27 992 379	%	61.710	96.360	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 13.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.932%	GBP	1'000.00	16.07.2015	16.07.2021	28 371 045		-	90.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.163%	EUR	1'000.00	16.07.2015	16.07.2021	27 992 863		-	96.990	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.07.2016	19.07.2021	31 524 514	%	102.240	95.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.07.2015	20.07.2021	27 992 358	%	64.290	96.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.07.2015	20.07.2021	27 992 394	%	88.870	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.79%	USD	1'000.00	20.07.2017	20.07.2021	37 046 874		-	92.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.761%	EUR	1'000.00	14.07.2015	21.07.2021	28 371 056		-	96.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.07.2017	21.07.2021	37 420 990	%	87.570	93.080	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 20.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.137%	EUR	1'000.00	03.07.2015	22.07.2021	27 992 779		-	95.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on S&P GSCI Crd OilER	EUR	1'000.00	22.07.2015	22.07.2021	27 992 372	%	70.990	96.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.999%	USD	1'000.00	28.06.2017	26.07.2021	37 153 646		-	93.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.07.2017	26.07.2021	37 153 824	%	89.850	92.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	27.07.2015	27.07.2021	28 371 058	%	84.170	96.590	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 25.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.07.2015	27.07.2021	28 781 870		-	100.000	100.000	25.01. 23.04. 23.07.	1.556 1.567 1.597	N
Reverse Convertible on Equities 26.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.298%	USD	1'000.00	28.07.2016	28.07.2021	33 244 676		-	94.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 26.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.298%	USD	1'000.00	28.07.2016	28.07.2021	33 244 677		-	94.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	30.07.2015	30.07.2021	28 371 074	%	106.320	89.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	30.07.2015	30.07.2021	27 992 430	%	91.630	96.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	30.07.2015	30.07.2021	28 370 956	%	96.110	89.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	01.08.2016	02.08.2021	33 244 696		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 31.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.057%	USD	1'000.00	02.08.2016	02.08.2021	33 244 707		-	94.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 31.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.588%	USD	1'000.00	02.08.2016	02.08.2021	33 244 717		-	94.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.917%	USD	1'000.00	09.02.2017	02.08.2021	35 550 824		-	91.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	02.08.2017	02.08.2021	37 643 877	%	99.040	99.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	03.08.2015	03.08.2021	28 370 968	%	112.490	89.640	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 2.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.362%	EUR	1'000.00	04.08.2015	04.08.2021	28 781 865		-	96.700	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	04.08.2015	04.08.2021	28 781 868	%	109.530	89.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	04.08.2015	04.08.2021	27 992 443	%	92.940	96.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.08.2015	04.08.2021	28 781 917		n.v.	100.000	100.000	02.02. 02.05. 02.08. 02.11.	1.443 1.462 1.548 1.572	N
Reverse Convertible on Inditex	EUR	1'000.00	04.08.2017	04.08.2021	37 420 878	%	88.390	99.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 2.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	05.08.2016	05.08.2021	32 829 631		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 3.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.932%	GBP	1'000.00	13.08.2015	06.08.2021	28 781 928		-	89.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.08.2017	09.08.2021	37 643 952	%	83.070	93.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	10.08.2015	10.08.2021	28 370 950	%	100.610	96.700	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	17.08.2015	10.08.2021	28 370 984	%	116.020	89.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.228%	USD	1'000.00	10.08.2017	10.08.2021	37 421 091		-	93.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.08.2017	10.08.2021	37 421 092	%	96.080	93.150	100.000		0.000	Y
1.9 % Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	11.08.2015	11.08.2021	28 370 948	%	95.310	95.340	100.000	09.08.	10.624	N
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.08.2015	11.08.2021	27 992 472	%	80.300	96.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.08.2017	11.08.2021	37 153 904	%	97.870	99.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 10.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.233%	GBP	1'000.00	12.08.2015	12.08.2021	28 781 832		-	89.740	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.08.2015	13.08.2021	27 992 488	%	75.920	96.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 16.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	JPY	100'000.00	16.08.2016	16.08.2021	33 244 991		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.08.2017	16.08.2021	37 644 097	%	94.210	93.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	SEK	1'000.00	16.08.2017	16.08.2021	30 041 319	%	98.060	99.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	16.08.2017	16.08.2021	37 420 921	%	93.490	99.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	17.08.2015	17.08.2021	27 992 510	%	86.430	96.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	17.08.2015	17.08.2021	28 782 003	%	90.460	89.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	17.08.2015	17.08.2021	28 370 998	%	113.550	89.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	17.08.2015	17.08.2021	28 782 002	%	98.870	89.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	17.08.2015	17.08.2021	28 782 000	%	97.860	89.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.08.2015	18.08.2021	28 781 933	%	106.720	96.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	18.08.2017	18.08.2021	37 643 984	%	100.700	99.760	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	19.08.2015	19.08.2021	28 781 992	%	107.450	89.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	SGD	1'000.00	19.08.2016	19.08.2021	33 597 420	%	87.680	91.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on S&P GSCI Crd OilER	USD	1'000.00	19.08.2016	19.08.2021	33 244 901	%	101.990	94.720	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Basket 16.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.646%	USD	1'000.00	20.08.2015	20.08.2021	28 781 935		-	89.740	100.000		0.000	Y
Callable Express Certificate on ESTXSD30 EUR P	EUR	1'000.00	27.08.2014	27.08.2021	24 565 193	%	118.670	93.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	27.08.2015	27.08.2021	27 992 578	%	114.190	97.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.542%	EUR	1'000.00	27.08.2015	27.08.2021	27 992 577		-	97.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.08.2016	30.08.2021	32 829 383	%	98.230	94.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	31.08.2015	31.08.2021	28 370 954	%	120.410	97.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Telefonica	EUR	1'000.00	31.08.2015	31.08.2021	28 782 026	%	48.450	96.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BBVA	EUR	1'000.00	31.08.2015	31.08.2021	28 782 025	%	76.090	96.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.08.2017	31.08.2021	37 749 590	%	92.450	93.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.08.2017	31.08.2021	37 749 506	%	99.350	93.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 2.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.143%	USD	1'000.00	01.09.2016	01.09.2021	33 597 583		-	94.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Orange	EUR	1'000.00	06.03.2017	06.09.2021	35 448 123	%	104.080	99.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.56%	EUR	1'000.00	07.09.2015	07.09.2021	27 992 589		-	97.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 1.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.183%	GBP	1'000.00	07.09.2015	07.09.2021	27 992 640		-	90.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.09.2017	07.09.2021	37 749 783	%	90.680	93.660	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Indices	EUR	1'000.00	08.09.2015	08.09.2021	28 782 031	%	90.060	86.930	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	08.09.2017	08.09.2021	37 749 925	%	98.400	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 8.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.479%	EUR	1'000.00	24.09.2015	10.09.2021	29 348 102		-	96.670	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	13.09.2016	13.09.2021	33 597 811		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 8.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	13.09.2016	13.09.2021	33 597 433		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.09.2017	13.09.2021	37 749 916	%	76.200	93.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	13.09.2016	14.09.2021	33 597 414	%	111.600	94.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.09.2017	14.09.2021	37 749 954	%	97.580	93.700	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.06.2015	15.09.2021	27 339 502	%	107.790	96.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 14.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.338%	GBP	1'000.00	16.09.2015	16.09.2021	28 781 950		-	90.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 14.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.338%	GBP	1'000.00	16.09.2015	16.09.2021	28 781 949		-	90.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 14.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.258%	GBP	1'000.00	16.09.2015	16.09.2021	28 781 948		-	90.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Repsol 14.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.385%	EUR	1'000.00	17.09.2015	17.09.2021	27 992 664		-	96.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	20.09.2017	20.09.2021	38 126 649	%	94.620	93.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Repsol 20.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.419%	EUR	1'000.00	21.09.2015	21.09.2021	27 992 677		-	96.990	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 17.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.808%	EUR	1'000.00	21.03.2016	21.09.2021	30 040 832		-	99.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 20.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 88.799%	AUD	1'000.00	22.09.2016	22.09.2021	33 597 688		-	90.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 20.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.93%	GBP	1'000.00	23.09.2016	22.09.2021	33 597 485		-	97.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 20.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.639%	USD	1'000.00	23.09.2016	22.09.2021	33 597 467		-	94.120	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Indices	USD	1'000.00	23.09.2016	23.09.2021	33 597 747	%	100.940	84.790	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	24.09.2015	24.09.2021	27 992 727	%	101.870	90.220	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 22.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.863%	EUR	1'000.00	24.03.2016	24.09.2021	30 041 136		-	99.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.09.2015	28.09.2021	29 348 083	%	100.850	96.590	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.09.2017	28.09.2021	38 126 751	%	99.390	93.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 14.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.511%	EUR	1'000.00	30.09.2015	30.09.2021	27 992 685		-	96.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	30.09.2015	30.09.2021	28 781 939	%	85.260	90.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.452%	EUR	1'000.00	30.09.2015	30.09.2021	27 992 722		-	96.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 14.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.392%	EUR	1'000.00	30.09.2015	30.09.2021	29 348 118		-	96.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTXBnk EUR P 28.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	30.09.2016	30.09.2021	33 705 951		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTXBnk EUR P	EUR	1'000.00	30.09.2016	30.09.2021	33 244 713	%	125.920	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 30.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	100'000.00	30.09.2016	30.09.2021	33 851 342		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 30.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.245%	EUR	1'000.00	01.10.2015	01.10.2021	27 992 729		-	96.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BNP Paribas P-A	EUR	1'000.00	27.09.2017	04.10.2021	38 126 943	%	89.880	99.680	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.10.2017	04.10.2021	38 309 944	%	22.820	99.680	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.10.2017	04.10.2021	38 126 721	%	84.820	99.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	28.09.2017	05.10.2021	38 310 140	%	93.840	99.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 4.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	06.10.2016	06.10.2021	33 851 166		-	94.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 4.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.913%	GBP	1'000.00	16.10.2015	07.10.2021	28 782 092		-	91.330	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	EUR	1'000.00	09.10.2015	11.10.2021	28 781 924	%	102.160	97.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Repsol Br	EUR	1'000.00	11.10.2017	11.10.2021	38 309 945	%	90.210	99.680	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.955%	USD	1'000.00	12.10.2016	12.10.2021	34 080 758		-	94.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	13.10.2015	13.10.2021	28 781 958	%	89.880	91.080	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.10.2016	14.10.2021	33 851 291	%	18.980	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 13.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.321%	GBP	1'000.00	15.10.2015	15.10.2021	29 348 253		-	91.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.10.2017	15.10.2021	38 310 304	%	97.720	92.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.306%	USD	1'000.00	18.10.2016	18.10.2021	34 080 791		-	93.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.10.2017	18.10.2021	38 486 145	%	86.100	92.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 16.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.683%	GBP	1'000.00	19.10.2015	19.10.2021	29 348 280		-	91.080	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.202%	USD	1'000.00	20.10.2016	20.10.2021	34 080 810		-	93.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	21.10.2015	21.10.2021	28 781 982	%	85.890	91.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.10.2017	21.10.2021	38 486 209	%	84.280	99.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 21.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.812%	EUR	1'000.00	22.10.2015	22.10.2021	28 782 133		-	97.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 21.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	25.10.2016	25.10.2021	33 851 429		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 23.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.338%	USD	1'000.00	25.10.2016	25.10.2021	34 080 850		-	93.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.10.2017	25.10.2021	38 310 286	%	93.060	99.680	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.10.2017	25.10.2021	38 485 675	%	91.480	92.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	25.10.2017	25.10.2021	38 310 173	%	92.510	96.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 27.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.908%	EUR	1'000.00	28.10.2015	27.10.2021	28 782 170		-	97.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.10.2017	27.10.2021	38 485 755	%	94.270	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	27.10.2017	27.10.2021	38 485 753	%	96.780	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 27.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.908%	EUR	1'000.00	28.10.2015	28.10.2021	28 782 168		-	97.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 26.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	28.10.2016	28.10.2021	34 080 834		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.197%	USD	1'000.00	01.11.2016	01.11.2021	34 080 903		-	93.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	02.11.2016	02.11.2021	34 080 591		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 4.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.813%	EUR	1'000.00	03.11.2015	03.11.2021	28 782 197		-	97.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.09.2017	03.11.2021	38 126 899	%	90.130	92.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.09.2017	03.11.2021	38 126 900	%	92.210	99.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.09.2017	03.11.2021	38 126 898	%	90.970	92.870	100.000		0.000	Y
Protection Participation on DAX	USD	1'000.00	03.11.2017	03.11.2021	38 486 370	%	98.620	92.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 3.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.422%	USD	1'000.00	04.11.2015	04.11.2021	29 348 200		-	91.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	04.11.2016	04.11.2021	34 080 629		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	04.11.2016	04.11.2021	34 080 630		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Banco Santander	EUR	1'000.00	06.11.2015	05.11.2021	30 040 738	%	99.190	97.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 7.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.372%	USD	1'000.00	21.10.2016	05.11.2021	34 080 837		-	93.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 5.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	21.10.2016	05.11.2021	34 080 838		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 5.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.48%	USD	1'000.00	21.10.2016	05.11.2021	34 080 839		-	93.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 7.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	21.10.2016	05.11.2021	34 080 836		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 5.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.24%	CAD	1'000.00	25.10.2016	05.11.2021	33 851 455		-	94.720	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	08.11.2016	08.11.2021	34 080 649	%	105.740	90.800	97.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 5.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.11.2016	08.11.2021	34 080 653		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	JPY	100'000.00	08.11.2016	08.11.2021	34 080 955		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 5.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.697%	GBP	1'000.00	09.11.2015	09.11.2021	30 040 754		-	90.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 9.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	11.11.2016	11.11.2021	34 080 990		-	99.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Credit Agricole	EUR	1'000.00	12.11.2015	12.11.2021	30 040 773	%	60.000	97.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 10.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	15.11.2016	15.11.2021	34 443 844		-	99.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 11.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.409%	GBP	1'000.00	16.11.2015	16.11.2021	29 348 251		-	90.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	16.11.2016	16.11.2021	34 080 643		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.438%	USD	1'000.00	17.11.2016	17.11.2021	34 540 738		-	93.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 15.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.96%	USD	1'000.00	17.11.2016	17.11.2021	30 041 235		-	93.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.299%	USD	1'000.00	17.11.2016	17.11.2021	34 540 735		-	93.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 15.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 88.545%	USD	1'000.00	18.11.2016	18.11.2021	34 443 672		-	92.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 17.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.956%	EUR	1'000.00	19.11.2015	19.11.2021	28 782 244		-	97.460	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	16.11.2015	22.11.2021	29 348 201	%	73.900	89.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 20.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.45%	USD	1'000.00	21.11.2016	22.11.2021	34 540 778		-	92.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 20.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.45%	USD	1'000.00	21.11.2016	22.11.2021	34 540 777		-	92.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.667%	EUR	1'000.00	23.11.2015	23.11.2021	28 782 078		-	97.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.11.2016	23.11.2021	34 540 798	%	35.830	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.86%	GBP	1'000.00	23.11.2016	23.11.2021	33 851 352		-	95.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	23.11.2016	23.11.2021	34 443 884		-	99.250	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	23.11.2016	23.11.2021	34 443 883		-	99.250	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.86% 21.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	GBP	1'000.00	23.11.2016	23.11.2021	33 851 353		-	95.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 23.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.027%	EUR	1'000.00	24.11.2015	24.11.2021	28 782 258		-	97.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 22.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	24.11.2016	24.11.2021	34 443 897		-	99.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 22.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	24.11.2016	24.11.2021	34 443 896		-	99.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.10.2017	24.11.2021	38 486 271	%	93.020	92.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.10.2017	24.11.2021	38 485 648	%	94.540	99.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	28.11.2016	29.11.2021	34 540 843	%	33.690	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	28.11.2016	29.11.2021	34 540 842	%	37.640	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	29.11.2016	29.11.2021	34 443 893	%	103.870	92.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 25.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	29.11.2016	29.11.2021	33 597 801		-	99.500	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 23.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	29.11.2016	29.11.2021	34 443 975		-	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	EUR	1'000.00	29.11.2016	29.11.2021	33 851 154	%	87.680	79.520	80.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 30.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 88.847%	USD	1'000.00	18.11.2016	30.11.2021	34 443 630		-	92.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	30.11.2016	30.11.2021	34 443 981		-	99.500	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.12.2017	01.12.2021	39 034 345	%	85.300	92.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Orange 2.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	02.12.2016	02.12.2021	34 540 663		-	99.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Telefonica	EUR	1'000.00	03.12.2015	03.12.2021	29 347 785	%	57.160	98.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Ralph Lauren-A	EUR	1'000.00	06.12.2016	03.12.2021	34 443 990	%	88.790	99.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 1.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.275%	USD	1'000.00	07.12.2015	07.12.2021	30 040 782		-	90.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.12.2017	08.12.2021	39 034 407	%	97.770	99.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Intesa Sanpaolo 9.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	13.12.2016	13.12.2021	34 540 946		-	99.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 88.63%	USD	1'000.00	14.12.2016	14.12.2021	34 765 544		-	91.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.12.2017	14.12.2021	39 164 062	%	99.720	91.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.12.2016	15.12.2021	34 765 668	%	97.110	91.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 15.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.32%	EUR	1'000.00	16.12.2015	16.12.2021	29 347 811		-	98.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	16.12.2016	16.12.2021	34 765 618		-	99.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.12.2017	20.12.2021	39 164 131	%	98.050	99.640	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	SEK	10'000.00	21.12.2016	21.12.2021	34 902 111	%	89.380	98.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.12.2015	23.12.2021	28 782 245	%	88.680	97.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	24.12.2015	24.12.2021	29 348 152	%	85.420	97.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 24.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	01.12.2016	24.12.2021	34 540 633		-	99.500	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 24.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 86.519%	USD	1'000.00	01.12.2016	24.12.2021	34 540 632		-	91.360	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 27.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 86.702%	USD	1'000.00	02.12.2016	27.12.2021	34 540 667		-	91.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 22.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 84.914%	USD	1'000.00	27.12.2016	27.12.2021	34 902 242		-	90.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 22.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.12.2016	27.12.2021	34 765 615		-	99.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	28.12.2015	28.12.2021	29 347 847	%	97.630	97.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 87.073%	USD	1'000.00	28.12.2016	28.12.2021	34 902 092		-	90.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.12.2016	28.12.2021	34 080 954	%	93.920	99.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 26.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.833%	GBP	1'000.00	29.12.2015	29.12.2021	30 497 725		-	91.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 84.853%	USD	1'000.00	29.12.2016	29.12.2021	34 902 241		-	90.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	29.12.2016	29.12.2021	34 902 091	%	93.460	95.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 23.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 88.794%	USD	1'000.00	30.12.2015	30.12.2021	29 348 233		-	89.900	100.000		0.000	Y
Capital Protection-Cert. (20.12.21) on Basket	USD	1'000.00	11.12.2013	03.01.2022	22 406 763	%	102.430	74.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 4.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 86.207%	USD	1'000.00	22.12.2016	03.01.2022	34 902 110		-	90.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 4.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 86.084%	USD	1'000.00	22.12.2016	03.01.2022	34 902 109		-	90.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 5.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 86.026%	USD	1'000.00	22.12.2016	03.01.2022	34 902 108		-	89.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.01.2017	03.01.2022	34 765 739	%	103.880	91.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Axa 4.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	29.12.2016	05.01.2022	35 135 256		-	99.500	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Repsol 12.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	13.01.2016	13.01.2022	29 347 893		-	97.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.01.2016	13.01.2022	30 497 883	%	75.560	90.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 11.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.591%	USD	1'000.00	19.01.2016	13.01.2022	30 497 885		-	90.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 11.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.591%	USD	1'000.00	19.01.2016	13.01.2022	30 497 884		-	90.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.01.2016	13.01.2022	30 497 882	%	100.580	90.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 12.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.396%	EUR	1'000.00	14.01.2016	14.01.2022	29 347 929		-	97.630	100.000		0.000	Y
Capital Protected Note on basket	CHF	1'000.00	17.01.2012	17.01.2022	13 921 266	%	113.490	88.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 13.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.369%	EUR	1'000.00	16.01.2017	17.01.2022	35 135 132		-	99.500	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.979%	EUR	1'000.00	17.01.2017	17.01.2022	35 135 092		-	99.500	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.006%	EUR	1'000.00	17.01.2017	17.01.2022	35 135 448		-	99.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.976%	EUR	1'000.00	23.01.2017	17.01.2022	35 327 779		-	99.500	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 16.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.411%	EUR	1'000.00	18.01.2016	18.01.2022	29 347 940		-	97.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 14.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	29.12.2016	18.01.2022	34 902 273		-	99.450	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 14.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 86.403%	USD	1'000.00	29.12.2016	18.01.2022	34 902 274		-	90.250	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	29.12.2016	18.01.2022	34 902 271		-	90.250	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	29.12.2016	18.01.2022	34 902 272		-	90.250	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.999%	USD	1'000.00	18.01.2017	18.01.2022	35 135 345		-	90.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 12.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.01.2017	18.01.2022	35 135 147		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.01.2017	18.01.2022	30 041 242	%	98.280	99.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.039%	USD	1'000.00	18.01.2017	18.01.2022	35 135 346		-	90.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 16.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.131%	GBP	1'000.00	19.01.2016	19.01.2022	29 347 967		-	91.670	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	19.01.2017	19.01.2022	34 902 300	%	105.340	91.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.155%	GBP	1'000.00	20.01.2016	20.01.2022	30 497 896		-	91.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	20.01.2017	20.01.2022	35 135 467	%	93.780	95.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	21.01.2016	21.01.2022	30 497 897	%	104.400	91.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 18.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.183%	GBP	1'000.00	21.01.2016	21.01.2022	29 348 240		-	91.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	22.01.2016	21.01.2022	30 497 976	%	106.290	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.01.2016	21.01.2022	29 347 972	%	82.080	90.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	24.01.2017	24.01.2022	34 765 660	%	100.270	90.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	24.01.2017	24.01.2022	35 135 325	%	80.590	95.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.321%	USD	1'000.00	24.01.2017	24.01.2022	35 135 470		-	90.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.92%	USD	1'000.00	24.01.2017	24.01.2022	35 327 780		-	90.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 23.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.29%	GBP	1'000.00	25.01.2016	25.01.2022	30 040 729		-	92.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.445%	USD	1'000.00	25.01.2017	25.01.2022	35 327 789		-	91.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 24.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.471%	EUR	1'000.00	02.02.2016	26.01.2022	29 348 008		-	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 24.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.259%	GBP	1'000.00	02.02.2016	26.01.2022	29 348 009		-	91.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.213%	GBP	1'000.00	29.01.2016	27.01.2022	29 348 026		-	92.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	31.01.2017	31.01.2022	35 448 028	%	97.000	95.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.214%	USD	1'000.00	31.01.2017	31.01.2022	35 448 044		-	90.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.272%	EUR	1'000.00	01.02.2017	31.01.2022	35 448 042		-	99.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	01.02.2016	01.02.2022	31 185 257	%	100.110	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.29%	GBP	1'000.00	01.02.2016	01.02.2022	30 498 010		-	92.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	CAD	1'000.00	01.02.2016	01.02.2022	30 498 014	%	107.020	93.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.553%	CAD	1'000.00	13.01.2017	01.02.2022	34 902 305		-	92.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.275%	USD	1'000.00	13.01.2017	01.02.2022	34 902 303		-	90.800	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	CAD	1'000.00	13.01.2017	01.02.2022	34 902 304	%	105.610	92.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	01.02.2017	01.02.2022	35 448 060		-	90.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.539%	USD	1'000.00	03.02.2017	01.02.2022	35 327 634		-	90.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 31.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	02.02.2017	02.02.2022	35 327 888		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CAD	1'000.00	03.02.2016	03.02.2022	31 185 267	%	84.900	93.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.02.2017	03.02.2022	35 327 912	%	99.130	99.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 2.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.881%	USD	1'000.00	04.02.2016	04.02.2022	31 185 260		-	91.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.02.2016	08.02.2022	31 185 278	%	96.090	98.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 6.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.519%	GBP	1'000.00	22.02.2016	08.02.2022	30 040 833		-	92.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 6.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.519%	GBP	1'000.00	22.02.2016	08.02.2022	30 040 834		-	92.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 6.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.519%	GBP	1'000.00	22.02.2016	08.02.2022	30 040 831		-	92.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.02.2017	08.02.2022	35 448 120	%	85.100	90.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 7.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.847%	NOK	1'000.00	08.02.2017	08.02.2022	35 327 951		-	92.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.398%	USD	1'000.00	09.02.2016	09.02.2022	30 040 843		-	92.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.398%	USD	1'000.00	09.02.2016	09.02.2022	30 040 844		-	92.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.398%	USD	1'000.00	09.02.2016	09.02.2022	30 040 846		-	92.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	09.02.2016	09.02.2022	30 040 840	%	102.360	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 8.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.683%	EUR	1'000.00	10.02.2016	10.02.2022	31 185 259		-	98.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTXSD30 EUR P 8.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.729%	EUR	1'000.00	10.02.2016	10.02.2022	30 040 851		-	98.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	10.02.2017	10.02.2022	34 902 251	%	104.940	99.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.02.2017	10.02.2022	35 327 995	%	107.750	90.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 9.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	GBP	1'000.00	11.02.2016	11.02.2022	29 348 243		-	93.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on IBEX 35 10.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.622%	EUR	1'000.00	11.02.2016	11.02.2022	30 040 816		-	98.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 11.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.119%	USD	1'000.00	26.01.2017	11.02.2022	35 327 594		-	90.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 11.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.063%	EUR	1'000.00	27.01.2017	11.02.2022	35 327 654		-	99.250	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.02.2016	14.02.2022	30 498 001	%	103.450	98.990	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 11.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.915%	USD	1'000.00	14.02.2017	14.02.2022	35 550 878		-	90.840	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 11.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	SGD	1'000.00	14.02.2017	14.02.2022	35 550 879		-	90.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 10.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.177%	USD	1'000.00	14.02.2017	14.02.2022	35 550 825		-	90.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 11.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.128%	USD	1'000.00	15.02.2017	15.02.2022	35 550 857		-	91.060	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 16.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.46%	USD	1'000.00	24.01.2017	16.02.2022	35 327 802		-	91.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 16.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	24.01.2017	16.02.2022	35 327 803		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 16.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.502%	EUR	1'000.00	24.01.2017	16.02.2022	35 327 801		-	99.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 17.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.267%	USD	1'000.00	31.01.2017	17.02.2022	35 327 684		-	90.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 15.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.629%	GBP	1'000.00	17.02.2017	17.02.2022	35 550 902		-	95.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Total 20.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.729%	EUR	1'000.00	22.02.2016	22.02.2022	30 040 888		-	98.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.555%	EUR	1'000.00	22.02.2017	22.02.2022	35 447 889		-	99.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.729%	EUR	1'000.00	23.02.2016	23.02.2022	31 524 348		-	98.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	SEK	10'000.00	23.02.2017	23.02.2022	35 327 742	%	86.790	98.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 21.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.179%	EUR	1'000.00	24.02.2017	24.02.2022	35 447 914		-	99.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.02.2017	24.02.2022	34 902 099	%	101.070	99.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 22.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.728%	EUR	1'000.00	25.02.2016	25.02.2022	30 498 004		-	98.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 23.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.715%	EUR	1'000.00	26.02.2016	25.02.2022	31 185 325		-	99.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.02.2017	28.02.2022	35 447 944	%	98.770	90.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.753%	USD	1'000.00	01.03.2017	01.03.2022	35 551 022		-	90.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	CAD	1'000.00	24.02.2016	03.03.2022	31 524 353	%	103.500	94.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 31.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.258%	USD	1'000.00	14.02.2017	03.03.2022	35 328 047		-	90.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 2.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.817%	EUR	1'000.00	04.03.2016	04.03.2022	30 460 415		-	99.280	100.000		0.000	Y
Express Certificate on Basket 2.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.354%	GBP	1'000.00	04.03.2016	04.03.2022	30 460 414		-	94.260	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	06.03.2017	07.03.2022	35 551 030	%	76.220	99.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.88%	USD	1'000.00	07.03.2017	07.03.2022	35 551 069		-	90.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.099%	EUR	1'000.00	08.03.2017	08.03.2022	35 551 094		-	99.500	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.03.2017	09.03.2022	35 551 047	%	94.350	90.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.919%	EUR	1'000.00	09.03.2017	09.03.2022	35 551 105		-	99.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.468%	USD	1'000.00	09.03.2017	09.03.2022	35 551 035		-	90.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	09.03.2017	09.03.2022	35 550 826	%	104.430	99.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.576%	EUR	1'000.00	09.03.2017	09.03.2022	35 550 423		-	99.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	09.03.2017	09.03.2022	35 550 422	%	89.970	99.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 12.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.79%	USD	1'000.00	21.02.2017	10.03.2022	35 447 879		-	90.210	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 12.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.88%	EUR	1'000.00	21.02.2017	10.03.2022	35 447 877		-	99.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on AXA 8.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.739%	EUR	1'000.00	10.03.2017	10.03.2022	35 550 442		-	99.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	10.03.2017	10.03.2022	35 550 913	%	85.370	96.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 9.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.711%	USD	1'000.00	11.03.2016	11.03.2022	31 524 401		-	92.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	14.03.2017	14.03.2022	35 448 113	%	98.030	95.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 12.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.192%	USD	1'000.00	14.03.2017	14.03.2022	35 550 503		-	90.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.272%	USD	1'000.00	14.03.2017	14.03.2022	35 550 910		-	90.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.192%	USD	1'000.00	14.03.2017	14.03.2022	35 914 139		-	90.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	15.03.2017	15.03.2022	35 550 880	%	99.740	99.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.789%	EUR	1'000.00	16.03.2016	16.03.2022	30 041 092		-	99.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	16.03.2017	16.03.2022	35 550 589	%	106.250	89.730	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 15.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.605%	USD	1'000.00	17.03.2016	17.03.2022	31 524 496		-	92.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 15.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.503%	EUR	1'000.00	17.03.2017	17.03.2022	35 550 608		-	98.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 17.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.725%	GBP	1'000.00	21.03.2016	21.03.2022	31 185 264		-	92.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 17.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.916%	USD	1'000.00	21.03.2016	21.03.2022	31 185 263		-	91.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 19.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.878%	GBP	1'000.00	21.03.2017	21.03.2022	35 327 758		-	95.620	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Qualcomm Rg	USD	1'000.00	21.03.2017	21.03.2022	35 550 675	%	119.880	89.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Renault	EUR	1'000.00	21.03.2017	21.03.2022	35 550 668	%	57.380	98.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Engie	EUR	1'000.00	22.03.2017	22.03.2022	35 550 707	%	69.650	98.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 21.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.666%	USD	1'000.00	23.03.2016	23.03.2022	30 041 124		-	91.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 21.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	23.03.2016	23.03.2022	30 041 126		-	98.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	23.03.2017	23.03.2022	35 448 116	%	103.470	98.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 22.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.772%	EUR	1'000.00	24.03.2016	24.03.2022	30 041 137		-	99.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 27.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.999%	EUR	1'000.00	22.02.2017	25.03.2022	35 447 904		-	99.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 24.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.12%	USD	1'000.00	04.04.2016	28.03.2022	31 524 560		-	92.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 28.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.895%	USD	1'000.00	24.02.2017	28.03.2022	35 447 905		-	90.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.013%	USD	1'000.00	02.03.2017	28.03.2022	35 447 970		-	90.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	27.03.2017	28.03.2022	35 914 301	%	100.600	90.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	28.03.2017	28.03.2022	35 135 293	%	89.900	95.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.03.2017	28.03.2022	35 914 215	%	60.860	90.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	29.03.2016	29.03.2022	31 524 505	%	73.700	93.480	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on General Electric Rg	USD	1'000.00	29.03.2017	29.03.2022	36 170 985	%	54.460	90.350	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Qualcomm Rg	USD	1'000.00	29.03.2017	29.03.2022	36 170 986	%	121.770	90.350	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Wells Fargo Rg	USD	1'000.00	29.03.2017	29.03.2022	36 170 984	%	105.660	90.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 22.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.924%	GBP	1'000.00	31.03.2016	31.03.2022	31 524 547		-	93.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 22.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.896%	GBP	1'000.00	31.03.2016	31.03.2022	31 524 548		-	93.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.03.2017	31.03.2022	35 914 271	%	100.620	90.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 31.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.513%	GBP	1'000.00	04.04.2016	04.04.2022	31 524 562		-	93.700	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 31.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.477%	GBP	1'000.00	04.04.2016	04.04.2022	30 497 960		-	93.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.04.2017	04.04.2022	36 170 993	%	50.770	90.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 3.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.472%	EUR	1'000.00	20.04.2016	05.04.2022	31 185 402		-	99.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 4.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.155%	USD	1'000.00	28.03.2017	05.04.2022	35 550 765		-	90.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.04.2017	05.04.2022	36 170 992	%	52.850	98.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 4.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.332%	USD	1'000.00	07.04.2016	07.04.2022	31 524 572		-	92.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 4.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.885%	EUR	1'000.00	07.04.2016	07.04.2022	31 185 429		-	99.280	100.000		0.000	Y
Certificate on EFG FP 2022 Index	CHF	100.00	07.05.2010	08.04.2022	11 062 269	%	103.160	59.800	80.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.533%	GBP	1'000.00	08.04.2016	08.04.2022	31 524 598		-	93.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.533%	GBP	1'000.00	08.04.2016	08.04.2022	31 524 599		-	93.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.568%	GBP	1'000.00	08.04.2016	08.04.2022	31 524 602		-	93.700	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.568%	GBP	1'000.00	08.04.2016	08.04.2022	31 524 601		-	93.700	100.000		0.000	Y
Protection Participation on iSh Co FTSE 100 GBP	GBP	1'000.00	08.04.2016	08.04.2022	31 524 600	%	106.110	84.280	90.000		0.000	Y
Kapitalschutz on Equities	CHF	1'000.00	11.04.2012	11.04.2022	14 674 024	%	53.640	86.860	97.000		0.000	Y
Capital Protection on Bluechip Basket	CHF	1'000.00	11.04.2012	11.04.2022	14 080 991	%	56.360	86.860	97.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 10.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.509%	EUR	1'000.00	11.04.2017	11.04.2022	36 171 093		-	99.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	11.04.2017	11.04.2022	36 171 014	%	99.810	96.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Axa 11.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.869%	EUR	1'000.00	21.04.2016	13.04.2022	31 525 628		-	99.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 13.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	JPY	10'000.00	18.04.2016	18.04.2022	31 524 521		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.917%	USD	1'000.00	18.04.2017	18.04.2022	36 171 231		-	90.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.142%	USD	1'000.00	18.04.2017	18.04.2022	36 171 249		-	90.880	100.000		0.000	Y
Structured Note	USD	1'000.00	16.04.2015	19.04.2022	27 339 588	%	102.070	94.060	100.000	19.04.	8.980	Y
Reverse Convertible on Equities 13.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.836%	GBP	1'000.00	19.04.2016	19.04.2022	31 185 480		-	94.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 13.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.48%	GBP	1'000.00	19.04.2016	19.04.2022	31 524 573		-	93.590	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	18.04.2017	19.04.2022	35 914 306	%	94.000	90.700	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 19.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.852%	CAD	1'000.00	21.03.2017	20.04.2022	35 550 659		-	92.020	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Basket 18.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.55%	USD	1'000.00	22.04.2016	22.04.2022	31 524 453		-	92.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.138%	EUR	1'000.00	22.03.2017	22.04.2022	35 914 199		-	98.640	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.734%	USD	1'000.00	22.03.2017	22.04.2022	35 914 198		-	89.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.088%	EUR	1'000.00	25.04.2016	26.04.2022	31 185 366		-	99.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.209%	EUR	1'000.00	26.04.2016	26.04.2022	31 524 670		-	99.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 26.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.817%	EUR	1'000.00	28.03.2017	26.04.2022	35 550 776		-	98.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 26.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.283%	USD	1'000.00	28.03.2017	26.04.2022	35 550 775		-	90.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	CHF	1'000.00	26.04.2017	26.04.2022	36 170 906	%	101.710	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.697%	EUR	1'000.00	27.04.2016	27.04.2022	31 524 614		-	99.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	29.03.2017	27.04.2022	35 550 800	%	55.790	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 26.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.389%	USD	1'000.00	28.04.2017	28.04.2022	36 170 940		-	91.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.368%	EUR	1'000.00	28.04.2017	28.04.2022	36 171 324		-	99.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 26.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.432%	USD	1'000.00	28.04.2017	28.04.2022	36 170 941		-	91.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 27.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.23%	CAD	1'000.00	29.04.2016	29.04.2022	31 185 546		-	92.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 27.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.222%	EUR	1'000.00	30.03.2017	29.04.2022	35 914 319		-	98.640	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.05.2017	02.05.2022	36 171 305	%	101.040	90.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.05.2017	02.05.2022	36 170 946	%	75.910	98.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 2.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 88.788%	USD	1'000.00	05.05.2016	05.05.2022	31 524 452		-	92.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 1.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.20%	GBP	1'000.00	05.05.2016	05.05.2022	31 524 662		-	92.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on AXA 2.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.235%	EUR	1'000.00	05.05.2017	05.05.2022	36 171 133		-	98.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 4.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.02%	GBP	1'000.00	06.05.2016	06.05.2022	31 524 458		-	92.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.423%	USD	1'000.00	29.03.2017	06.05.2022	35 914 219		-	90.250	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	05.05.2017	09.05.2022	35 914 176	%	96.760	99.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	09.11.2017	09.05.2022	38 486 030	%	95.840	91.390	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	09.11.2017	09.05.2022	38 486 014	%	97.950	91.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.875%	EUR	1'000.00	10.05.2017	10.05.2022	36 171 182		-	99.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.931%	USD	1'000.00	15.05.2017	10.05.2022	36 171 554		-	90.640	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.163%	EUR	1'000.00	15.05.2017	10.05.2022	36 171 555		-	98.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	10'000.00	10.08.2017	10.05.2022	37 643 916	%	100.550	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 9.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.305%	EUR	1'000.00	11.05.2017	11.05.2022	36 171 533		-	99.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.305%	EUR	1'000.00	11.05.2017	11.05.2022	36 171 534		-	99.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 9.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.761%	EUR	1'000.00	11.05.2017	11.05.2022	36 171 139		-	98.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.305%	EUR	1'000.00	11.05.2017	11.05.2022	36 171 528		-	99.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.818%	EUR	1'000.00	11.05.2017	11.05.2022	36 171 194		-	98.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.20%	EUR	1'000.00	11.05.2017	11.05.2022	36 171 199		-	98.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.047%	USD	1'000.00	11.05.2017	11.05.2022	36 171 527		-	90.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Total	EUR	1'000.00	12.05.2017	11.05.2022	36 171 346	%	101.460	98.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Total 9.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.647%	EUR	1'000.00	12.05.2017	11.05.2022	36 171 344		-	98.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 14.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.205%	EUR	1'000.00	19.04.2017	12.05.2022	36 171 242		-	99.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 14.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.615%	GBP	1'000.00	19.04.2017	12.05.2022	36 171 243		-	96.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 14.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.205%	EUR	1'000.00	19.04.2017	12.05.2022	36 171 244		-	99.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 14.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.615%	GBP	1'000.00	19.04.2017	12.05.2022	36 171 245		-	96.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	16.05.2017	16.05.2022	36 171 355	%	95.000	90.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.13%	EUR	1'000.00	16.05.2017	16.05.2022	36 171 556		-	98.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.05.2017	16.05.2022	36 171 372	%	70.930	90.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Total	EUR	1'000.00	17.05.2017	16.05.2022	36 171 398	%	98.430	98.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.05.2017	17.05.2022	36 171 386	%	79.640	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.05.2017	17.05.2022	36 171 384	%	86.970	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	17.05.2017	17.05.2022	36 171 385	%	87.780	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.05.2017	17.05.2022	35 914 158	%	97.880	98.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 15.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.09%	USD	1'000.00	17.05.2017	17.05.2022	36 171 584		-	90.800	100.000		0.000	Y
Worst of Express Certificate on Bouygues 15.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.43%	EUR	1'000.00	23.04.2014	18.05.2022	23 581 058		-	87.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 21.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.386%	USD	1'000.00	21.04.2017	19.05.2022	36 170 880		-	91.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.168%	EUR	1'000.00	16.05.2017	19.05.2022	36 171 368		-	98.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Gas Natural SDG Br	EUR	1'000.00	19.05.2017	19.05.2022	36 171 708	%	86.110	98.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.05.2017	19.05.2022	36 171 704	%	99.390	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.05.2017	19.05.2022	36 171 705	%	81.140	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	22.05.2017	20.05.2022	36 171 387	%	93.030	90.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 15.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.682%	USD	1'000.00	23.05.2016	23.05.2022	31 185 608		-	92.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.05.2017	23.05.2022	36 171 714	%	78.490	91.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 22.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.071%	EUR	1'000.00	24.05.2016	24.05.2022	31 524 657		-	99.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	25.05.2017	25.05.2022	36 171 658	%	102.180	99.100	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.05.2017	26.05.2022	36 171 538	%	100.400	90.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	26.05.2017	26.05.2022	36 786 273	%	95.390	99.010	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTXSD30 EUR P	EUR	1'000.00	26.05.2017	26.05.2022	36 171 562	%	98.100	89.110	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.05.2017	26.05.2022	36 171 693	%	71.380	91.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.05.2015	27.05.2022	27 992 831	%	96.710	93.470	100.000	30.05.	9.830	Y
Reverse Convertible on Equities 23.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.184%	EUR	1'000.00	27.05.2016	27.05.2022	32 339 455		-	99.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.05.2017	30.05.2022	36 786 288	%	80.600	98.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Telefonica Br	EUR	1'000.00	26.05.2017	31.05.2022	36 171 691	%	87.620	99.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	01.06.2017	01.06.2022	36 786 165	%	95.880	91.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 5.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	28.03.2017	03.06.2022	35 550 764		-	98.360	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 5.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	05.04.2017	03.06.2022	35 914 392		-	90.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 5.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	AUD	1'000.00	04.05.2017	03.06.2022	36 171 156		-	88.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.06.2017	06.06.2022	36 786 225	%	100.110	99.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 2.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.425%	EUR	1'000.00	07.06.2016	07.06.2022	31 524 534		-	99.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 2.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 88.247%	USD	1'000.00	07.06.2016	07.06.2022	31 185 715		-	91.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 7.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.864%	CAD	1'000.00	09.05.2017	07.06.2022	36 171 171		-	93.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.528%	USD	1'000.00	07.06.2017	07.06.2022	36 786 470		-	91.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.06.2017	07.06.2022	36 786 252	%	96.110	99.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.402%	EUR	1'000.00	07.06.2017	07.06.2022	36 786 471		-	99.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.398%	EUR	1'000.00	08.06.2016	08.06.2022	32 339 474		-	99.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.519%	USD	1'000.00	08.06.2017	08.06.2022	36 786 479		-	91.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	08.06.2017	08.06.2022	36 786 499	%	113.340	99.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 6.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.431%	EUR	1'000.00	09.06.2016	09.06.2022	31 185 739		-	99.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	09.12.2016	09.06.2022	34 540 920		-	99.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Telefonica Br	EUR	1'000.00	06.06.2017	09.06.2022	36 786 238	%	82.760	99.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on AXA 11.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.037%	EUR	1'000.00	06.06.2017	09.06.2022	36 786 237		-	99.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	09.06.2017	09.06.2022	36 786 501	%	86.930	99.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.06.2017	09.06.2022	36 786 502	%	88.680	91.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 7.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.555%	USD	1'000.00	10.06.2016	10.06.2022	31 185 754		-	92.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 12.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.501%	USD	1'000.00	13.06.2017	13.06.2022	36 786 529		-	91.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.748%	USD	1'000.00	14.06.2017	14.06.2022	37 046 921		-	91.560	100.000		0.000	Y
Protection Participation on PIMCO INCOME	USD	1'000.00	15.06.2017	15.06.2022	37 046 942	%	95.190	86.720	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ArcelorMittal Rg 13.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.204%	EUR	1'000.00	15.06.2017	15.06.2022	36 786 442		-	99.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.147%	EUR	1'000.00	15.06.2017	15.06.2022	36 786 449		-	99.250	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.04.2017	16.06.2022	36 171 261	%	71.290	99.280	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 18.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.51%	EUR	1'000.00	24.04.2017	16.06.2022	36 171 262		-	99.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Twenty-First Cent-A 18.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.037%	EUR	1'000.00	13.06.2017	16.06.2022	36 786 383		-	99.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.06.2017	16.06.2022	37 046 948	%	96.780	91.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.06.2017	16.06.2022	37 046 953	%	97.220	99.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	16.06.2017	16.06.2022	36 171 233	%	95.490	99.250	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.06.2017	20.06.2022	36 786 600	%	98.210	91.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.06.2017	20.06.2022	36 786 563	%	96.630	99.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.437%	USD	1'000.00	21.06.2017	21.06.2022	37 046 975		-	91.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 26.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.659%	USD	1'000.00	24.05.2017	23.06.2022	36 171 632		-	91.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 26.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.664%	USD	1'000.00	25.05.2017	23.06.2022	36 171 633		-	91.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.06.2017	23.06.2022	37 046 656	%	97.890	91.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.06.2017	23.06.2022	37 046 655	%	96.840	91.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	10'000.00	22.06.2017	27.06.2022	36 786 359	%	96.420	99.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	CAD	1'000.00	27.06.2017	27.06.2022	37 046 684	%	94.370	92.780	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	27.06.2017	27.06.2022	37 046 664	%	98.080	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	27.06.2017	27.06.2022	37 153 631		-	91.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.06.2017	28.06.2022	37 046 994	%	87.410	91.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.06.2017	28.06.2022	30 041 292	%	103.160	91.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 26.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.627%	USD	1'000.00	28.06.2017	28.06.2022	37 153 649		-	91.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.67%	USD	1'000.00	29.06.2017	29.06.2022	37 153 677		-	91.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 27.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.555%	USD	1'000.00	30.06.2016	30.06.2022	32 339 587		-	92.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 3.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.192%	USD	1'000.00	30.06.2016	30.06.2022	32 339 406		-	92.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.06.2017	30.06.2022	37 046 751	%	105.740	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 29.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.797%	GBP	1'000.00	04.07.2016	04.07.2022	32 339 408		-	95.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	24.05.2017	04.07.2022	36 171 641	%	101.200	99.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	24.05.2017	05.07.2022	36 171 642	%	101.630	91.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.881%	EUR	1'000.00	25.05.2017	05.07.2022	36 171 640		-	99.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	31.05.2017	05.07.2022	36 786 135	%	100.540	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.07.2017	05.07.2022	37 153 702	%	88.070	91.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	05.07.2017	05.07.2022	36 171 507	%	90.110	91.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.07.2017	05.07.2022	37 046 779	%	105.450	91.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.134%	USD	1'000.00	05.07.2017	05.07.2022	37 046 780		-	91.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.07.2017	05.07.2022	37 153 698	%	28.110	99.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.356%	USD	1'000.00	05.07.2017	05.07.2022	37 153 694		-	91.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.447%	USD	1'000.00	05.07.2017	05.07.2022	37 153 697		-	91.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.07.2017	05.07.2022	37 153 699	%	47.860	99.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.07.2017	06.07.2022	37 046 809	%	101.810	98.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	07.07.2017	07.07.2022	37 153 666	%	95.680	95.290	100.000		0.000	Y
Step Certificate on Basket	CHF	1'000.00	10.07.2012	08.07.2022	18 082 526	%	132.230	90.530	100.000		0.000	Y
Capital Protection on Basket	CHF	1'000.00	10.07.2012	08.07.2022	18 082 628	%	55.230	87.820	97.000		0.000	Y
Reverse Convertible	EUR	1'000.00	22.07.2016	11.07.2022	32 829 638	%	102.760	87.820	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Sanofi 7.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.235%	EUR	1'000.00	11.01.2017	11.07.2022	34 902 135		-	99.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 11.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.561%	USD	1'000.00	12.07.2017	12.07.2022	37 046 855		-	90.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.07.2017	12.07.2022	37 046 882	%	99.080	90.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.07.2017	12.07.2022	37 046 883	%	103.930	90.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	16.05.2017	14.07.2022	36 171 369	%	107.020	98.670	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	14.07.2017	14.07.2022	37 153 674	%	95.970	98.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	18.07.2017	18.07.2022	37 046 955	%	93.530	95.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 16.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.596%	USD	1'000.00	18.07.2017	18.07.2022	37 153 778		-	90.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	18.07.2017	18.07.2022	37 153 808	%	100.290	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CAD	1'000.00	18.07.2017	18.07.2022	37 153 835	%	101.640	91.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	100.85	15.08.2017	18.07.2022	37 644 123	CHF	118.530	98.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.01.2017	19.07.2022	35 135 286	%	37.050	99.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	19.07.2017	19.07.2022	37 153 928	%	102.310	90.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	19.07.2017	19.07.2022	37 153 848	%	99.390	98.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.817%	USD	1'000.00	19.07.2017	19.07.2022	37 153 979		-	90.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	CHF	1'000.00	20.07.2017	20.07.2022	37 153 875	%	100.530	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	21.07.2017	21.07.2022	36 786 313	%	96.030	98.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	21.07.2017	21.07.2022	37 153 901	%	102.080	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.07.2017	21.07.2022	37 153 896	%	80.810	98.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.07.2017	21.07.2022	37 153 897	%	101.160	98.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	22.07.2016	22.07.2022	32 339 522		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.07.2017	25.07.2022	37 153 981	%	94.230	98.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.07.2017	25.07.2022	37 153 982	%	96.130	91.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 24.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	26.07.2016	26.07.2022	32 829 463		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.07.2016	27.07.2022	33 244 685		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Saint-Gobain	EUR	1'000.00	27.07.2017	27.07.2022	37 420 835	%	95.250	98.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Ingenico Group	EUR	1'000.00	27.07.2017	27.07.2022	37 420 833	%	101.100	98.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.07.2017	27.07.2022	37 153 929	%	90.970	98.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Lvmh 26.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	28.07.2016	28.07.2022	32 829 487		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.05%	EUR	1'000.00	20.06.2017	28.07.2022	37 046 980		-	99.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	20.06.2017	28.07.2022	37 046 978	%	99.910	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	20.06.2017	28.07.2022	37 046 976	%	100.690	91.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.05%	EUR	1'000.00	20.06.2017	28.07.2022	37 046 993		-	99.190	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	20.06.2017	28.07.2022	37 046 979		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	20.06.2017	28.07.2022	37 046 977	%	100.020	99.190	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Ambev Sp ADS	USD	1'000.00	21.07.2017	28.07.2022	37 153 883	%	112.180	90.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 27.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	29.07.2016	29.07.2022	33 244 678		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 27.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.314%	GBP	1'000.00	29.07.2016	29.07.2022	32 339 641		-	96.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.308%	USD	1'000.00	24.08.2017	29.07.2022	37 749 707		-	91.490	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	30.07.2015	01.08.2022	27 992 452	%	100.260	96.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 30.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	01.08.2016	01.08.2022	32 339 045		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Peugeot 30.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.068%	EUR	1'000.00	01.08.2017	01.08.2022	37 420 893		-	98.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	01.08.2017	01.08.2022	37 643 903	%	89.690	98.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.08.2017	01.08.2022	37 643 876	%	88.720	91.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.08.2017	01.08.2022	37 643 871	%	96.630	98.810	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.08.2017	01.08.2022	37 643 879	%	100.540	91.180	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.08.2017	01.08.2022	37 643 880	%	100.600	91.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.08.2017	01.08.2022	37 643 875	%	101.660	91.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	08.08.2017	01.08.2022	37 643 899	%	95.080	95.590	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.08.2017	01.08.2022	30 041 309	%	98.330	90.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.08.2017	01.08.2022	37 643 897	%	97.590	91.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.08.2017	01.08.2022	37 643 898	%	99.290	98.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	02.08.2016	02.08.2022	33 244 697		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.08.2017	02.08.2022	37 643 912	%	93.790	90.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.08.2017	02.08.2022	37 643 909	%	100.440	90.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.869%	USD	1'000.00	08.08.2017	02.08.2022	37 643 910		-	90.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	01.08.2016	03.08.2022	32 829 515		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	28.06.2017	03.08.2022	37 046 718	%	100.160	99.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	28.06.2017	03.08.2022	37 046 701	%	100.610	91.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	28.06.2017	03.08.2022	37 046 700	%	99.990	99.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	28.06.2017	03.08.2022	37 046 702	%	99.680	96.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	28.06.2017	03.08.2022	37 046 714	%	102.770	91.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 1.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.908%	USD	1'000.00	03.08.2017	03.08.2022	37 643 933		-	90.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.987%	EUR	1'000.00	03.08.2017	03.08.2022	37 643 914		-	98.760	100.000	01.11.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.08.2017	03.08.2022	37 643 932	%	97.810	91.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.08.2017	04.08.2022	37 420 959	%	91.010	91.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	11.08.2017	04.08.2022	37 420 954	%	98.410	98.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 2.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	04.08.2016	05.08.2022	32 829 493		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.08.2016	05.08.2022	32 829 572	%	102.380	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 2.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	05.08.2016	05.08.2022	33 244 766		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 31.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.761%	GBP	1'000.00	05.08.2016	05.08.2022	33 244 690		-	96.590	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	05.08.2016	05.08.2022	32 829 601		-	99.580	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.07.2017	05.08.2022	37 153 807		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.08.2017	05.08.2022	37 420 933	%	25.550	98.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.08.2017	05.08.2022	37 644 110	%	87.190	91.110	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	08.08.2017	08.08.2022	37 421 054	%	95.630	91.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	09.08.2016	09.08.2022	33 244 782		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	09.08.2016	09.08.2022	33 244 781		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	NOK	1'000.00	09.08.2017	09.08.2022	37 421 083	%	100.200	92.730	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 5.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.927%	USD	1'000.00	09.08.2017	09.08.2022	37 421 063		-	91.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	09.08.2017	09.08.2022	37 421 055	%	99.730	98.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	09.08.2017	09.08.2022	37 421 082	%	100.420	91.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Engie	EUR	1'000.00	10.08.2016	10.08.2022	33 244 792	%	114.860	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 8.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	10.08.2016	10.08.2022	33 244 786		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	11.08.2016	11.08.2022	33 244 810		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 9.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.476%	GBP	1'000.00	11.08.2016	11.08.2022	33 244 729		-	96.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 9.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.409%	GBP	1'000.00	11.08.2016	11.08.2022	33 244 963		-	96.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	19.05.2017	12.08.2022	36 171 551	%	88.120	90.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	15.08.2016	15.08.2022	33 244 986	%	106.040	92.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	13.02.2017	15.08.2022	35 327 931	%	101.580	89.530	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 11.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.534%	EUR	1'000.00	15.02.2017	15.08.2022	35 328 036		-	98.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Bouygues 11.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.534%	EUR	1'000.00	15.02.2017	15.08.2022	35 328 034		-	98.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.08.2017	15.08.2022	37 643 881	%	100.430	91.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on NVIDIA Rg 13.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.089%	USD	1'000.00	15.08.2017	15.08.2022	37 643 849		-	91.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.08.2017	15.08.2022	37 643 853	%	93.130	98.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.049%	USD	1'000.00	15.08.2017	15.08.2022	37 643 865		-	91.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.08.2017	15.08.2022	37 643 854	%	94.410	91.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	22.08.2017	15.08.2022	30 041 316	%	100.000	91.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.08.2017	15.08.2022	30 041 315	%	100.150	91.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 11.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.091%	USD	1'000.00	16.08.2016	16.08.2022	33 245 060		-	92.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.08.2017	16.08.2022	37 643 959	%	84.090	91.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 15.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	17.08.2016	17.08.2022	33 244 862		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	17.08.2017	17.08.2022	37 643 936	%	98.400	96.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 15.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.089%	USD	1'000.00	17.08.2017	17.08.2022	37 749 658		-	91.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	SGD	50'000.00	18.08.2017	18.08.2022	37 643 979	%	100.370	91.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 18.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.188%	GBP	1'000.00	22.08.2016	22.08.2022	33 244 962		-	97.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 20.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.32%	USD	1'000.00	22.08.2017	22.08.2022	37 749 685		-	91.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	AUD	1'000.00	22.08.2017	22.08.2022	37 644 007	%	100.690	88.770	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 23.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 87.614%	USD	1'000.00	24.08.2016	24.08.2022	32 829 374		-	93.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 22.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.272%	USD	1'000.00	24.08.2016	24.08.2022	33 245 085		-	92.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 22.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.311%	EUR	1'000.00	24.08.2017	24.08.2022	37 749 708		-	98.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 22.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.23%	USD	1'000.00	24.08.2017	24.08.2022	37 749 709		-	91.290	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.08.2017	24.08.2022	37 749 696	%	82.710	98.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.08.2016	25.08.2022	30 041 225	%	53.540	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	25.08.2017	25.08.2022	37 153 725	%	97.240	99.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.325%	USD	1'000.00	29.08.2017	29.08.2022	37 749 557		-	91.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.473%	EUR	1'000.00	29.08.2017	29.08.2022	37 749 744		-	99.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.08.2017	29.08.2022	37 749 732	%	87.680	91.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.416%	USD	1'000.00	29.08.2017	29.08.2022	37 749 543		-	91.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.08.2017	29.08.2022	37 749 544	%	88.500	91.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.275%	USD	1'000.00	29.08.2017	29.08.2022	37 749 747		-	91.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 29.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.973%	GBP	1'000.00	30.08.2016	30.08.2022	33 245 034		-	96.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 29.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.973%	GBP	1'000.00	30.08.2016	30.08.2022	33 245 035		-	96.820	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 28.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	30.08.2016	30.08.2022	33 244 955		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 28.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.602%	USD	1'000.00	30.08.2016	30.08.2022	33 245 833		-	93.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.08.2017	30.08.2022	37 749 884	%	19.690	99.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	31.08.2017	31.08.2022	37 749 890	%	33.720	99.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	CAD	1'000.00	01.09.2016	01.09.2022	33 597 605	%	74.830	94.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.32%	USD	1'000.00	01.09.2017	01.09.2022	37 749 891		-	91.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	01.09.2017	01.09.2022	37 749 610	%	99.560	99.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.09.2017	01.09.2022	37 749 602	%	93.540	91.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.006%	USD	1'000.00	27.07.2017	02.09.2022	37 420 850		-	90.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	27.07.2017	02.09.2022	37 420 843	%	100.340	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CAD	1'000.00	27.07.2017	02.09.2022	37 420 849	%	76.840	91.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.006%	USD	1'000.00	27.07.2017	02.09.2022	37 420 846		-	90.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.006%	USD	1'000.00	27.07.2017	02.09.2022	37 420 844		-	90.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	27.07.2017	02.09.2022	37 420 848	%	99.050	90.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 30.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.582%	EUR	1'000.00	27.07.2017	02.09.2022	37 420 847		-	98.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 30.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.006%	USD	1'000.00	27.07.2017	02.09.2022	37 420 845		-	90.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CAD	1'000.00	27.07.2017	02.09.2022	37 420 842	%	98.280	91.030	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	27.07.2017	02.09.2022	37 420 841	%	99.520	98.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.09.2017	05.09.2022	37 749 623	%	97.290	99.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Renault	EUR	1'000.00	05.09.2017	05.09.2022	37 749 778	%	103.360	99.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.08.2017	06.09.2022	37 749 698	%	108.160	91.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	23.08.2017	06.09.2022	37 749 702	%	100.060	91.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.08.2017	06.09.2022	37 749 700	%	100.660	98.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.164%	USD	1'000.00	23.08.2017	06.09.2022	37 644 035		-	91.180	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.297% 1.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	29.08.2017	06.09.2022	37 749 549		-	91.340	100.000	01.12. 01.12.	0.000 9.880	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	06.09.2017	06.09.2022	37 749 498	%	79.710	96.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 5.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	07.09.2016	07.09.2022	33 244 968		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 6.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.358%	USD	100'000.00	01.09.2017	07.09.2022	37 749 517		-	91.390	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Orange	EUR	1'000.00	07.09.2017	08.09.2022	37 749 957	%	102.980	99.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CAD	1'000.00	08.09.2017	08.09.2022	37 749 861		-	91.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.09.2017	12.09.2022	37 749 912	%	90.240	91.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 11.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.312%	USD	100'000.00	05.09.2017	13.09.2022	37 749 550		-	91.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.09.2017	13.09.2022	37 644 119	%	98.040	91.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 10.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	14.09.2016	14.09.2022	33 597 538		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Telefonica 10.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	21.09.2016	14.09.2022	33 597 539		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Societe Generale 9.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	15.09.2016	15.09.2022	33 597 822		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	15.09.2017	15.09.2022	30 041 335	%	102.160	99.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	16.09.2016	16.09.2022	33 597 625		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	16.09.2016	16.09.2022	33 597 624		-	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 15.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 87.616%	USD	1'000.00	17.09.2014	19.09.2022	24 565 703		-	82.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Telefonica 16.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	19.09.2016	19.09.2022	33 597 641		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	19.09.2017	19.09.2022	38 126 852	%	96.890	96.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.09.2017	19.09.2022	38 126 859	%	92.720	91.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 11.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.857%	EUR	1'000.00	19.09.2017	19.09.2022	38 126 594		-	99.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 18.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.033%	USD	1'000.00	20.09.2016	20.09.2022	32 829 391		-	92.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 16.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	20.09.2016	20.09.2022	33 597 519		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	20.09.2017	20.09.2022	38 126 675	%	92.710	99.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.316%	USD	1'000.00	20.09.2017	20.09.2022	38 126 924		-	91.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.472%	EUR	1'000.00	20.09.2017	20.09.2022	38 126 925		-	99.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.175%	USD	1'000.00	21.09.2017	21.09.2022	38 126 753		-	91.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on TevaPharmInd Sp ADR	USD	1'000.00	21.09.2017	21.09.2022	38 310 052	%	94.730	91.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BMW 21.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	17.10.2016	23.09.2022	33 597 735		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Engie 21.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	17.10.2016	23.09.2022	33 597 732		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Casino Gp 21.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	17.10.2016	23.09.2022	33 597 733		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Societe Generale 21.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	17.10.2016	23.09.2022	33 597 734		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 22.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.074%	USD	1'000.00	26.09.2017	26.09.2022	38 310 113		-	91.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	26.09.2017	26.09.2022	38 126 777	%	98.880	91.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.09.2017	26.09.2022	38 126 896	%	92.130	98.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	26.09.2017	26.09.2022	38 126 895	%	98.040	98.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.10.2017	26.09.2022	38 310 071	%	96.490	91.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.10.2017	26.09.2022	30 041 343	%	100.150	91.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.10.2017	26.09.2022	30 041 344	%	98.550	91.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Total	EUR	1'000.00	27.03.2017	27.09.2022	35 550 742	%	109.770	98.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.09.2017	27.09.2022	38 126 945	%	102.500	98.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 24.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	28.09.2016	28.09.2022	33 851 207		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	29.09.2016	29.09.2022	33 597 739		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	29.09.2016	29.09.2022	33 597 704	%	110.270	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	29.09.2016	29.09.2022	32 829 392	%	101.000	92.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	29.09.2017	29.09.2022	38 126 771	%	81.080	98.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	29.09.2017	29.09.2022	38 126 770	%	92.680	98.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 29.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.988%	EUR	1'000.00	29.09.2017	29.09.2022	38 310 154		-	98.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 28.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 87.297%	USD	1'000.00	30.09.2016	30.09.2022	32 339 507		-	92.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.10.2017	03.10.2022	38 310 174	%	95.990	90.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Gemalto Br	EUR	1'000.00	03.10.2017	03.10.2022	38 309 940	%	101.110	98.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.10.2017	03.10.2022	30 041 349	%	99.790	90.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.10.2017	04.10.2022	38 310 190	%	96.970	98.760	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTXBnk EUR P	EUR	1'000.00	04.10.2017	04.10.2022	38 309 998	%	90.830	98.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	04.10.2017	04.10.2022	38 310 011	%	98.480	90.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 2.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.544%	USD	1'000.00	05.10.2016	05.10.2022	33 851 160		-	93.200	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	EUR	1'000.00	05.10.2016	05.10.2022	33 851 107	%	96.850	90.000	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	06.09.2017	05.10.2022	37 749 956	%	100.580	91.520	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	05.10.2017	05.10.2022	38 310 018	%	97.160	98.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.10.2017	06.10.2022	38 310 212	%	94.030	90.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	06.10.2017	06.10.2022	37 644 109	%	94.570	98.810	100.000		0.000	Y
Protection-Cert. on Equities	CHF	1'000.00	08.10.2012	07.10.2022	18 737 229	%	131.720	72.930	80.000		0.000	Y
Capital Protection-Cert. on Equities	CHF	1'000.00	08.10.2012	07.10.2022	18 961 675	%	132.890	82.290	90.000		0.000	Y
Capital Protection on Basket	CHF	1'000.00	08.10.2012	07.10.2022	18 565 899	%	54.720	88.600	97.000		0.000	Y
Step Certificate on Equities	CHF	1'000.00	08.10.2012	07.10.2022	18 565 898	%	128.930	91.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 4.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	07.10.2016	07.10.2022	33 851 075		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 4.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	07.10.2016	07.10.2022	33 851 076		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 11.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	04.04.2017	11.10.2022	35 914 220		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.10.2017	11.10.2022	38 310 237	%	98.800	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.10.2017	12.10.2022	38 486 136	%	85.120	98.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.10.2017	12.10.2022	38 310 297	%	77.160	90.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 10.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 88.171%	USD	1'000.00	13.10.2016	13.10.2022	33 851 173		-	92.600	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BBVA 12.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	14.10.2016	14.10.2022	33 851 294		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Telefonica 12.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	14.10.2016	14.10.2022	33 851 210		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on IBEX 35 12.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	14.10.2016	14.10.2022	33 851 295		-	99.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	14.10.2016	14.10.2022	33 851 129		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	07.09.2017	14.10.2022	37 749 849	%	101.340	91.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	07.09.2017	14.10.2022	37 749 850	%	99.290	99.140	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on IBEX 35 13.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 88.509%	USD	1'000.00	17.10.2016	17.10.2022	33 851 221		-	92.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 12.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 87.942%	USD	1'000.00	17.10.2016	17.10.2022	33 851 179		-	92.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 12.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 87.942%	USD	1'000.00	17.10.2016	17.10.2022	33 851 180		-	92.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 12.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	17.10.2016	17.10.2022	33 851 302		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	03.10.2017	17.10.2022	38 310 175	%	87.050	90.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 21.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.821%	GBP	1'000.00	14.10.2016	19.10.2022	34 080 704		-	96.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.10.2017	19.10.2022	38 486 155	%	94.020	98.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.10.2017	19.10.2022	38 485 552	%	97.370	98.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on GDF Suez	EUR	1'000.00	20.10.2014	20.10.2022	24 565 725	%	90.060	92.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 18.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	20.10.2016	20.10.2022	33 851 399		-	99.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	07.09.2017	20.10.2022	38 126 796	%	98.060	99.080	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	07.09.2017	20.10.2022	37 749 848	%	98.950	91.410	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	08.09.2017	20.10.2022	38 126 797	%	98.450	91.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	20.10.2017	20.10.2022	38 486 251	%	95.020	98.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.10.2017	20.10.2022	38 486 213	%	98.620	98.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.10.2017	20.10.2022	38 486 214	%	98.970	90.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	20.10.2017	20.10.2022	38 486 215	%	99.240	94.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 20.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	24.10.2016	24.10.2022	34 080 799		-	99.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 21.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 87.534%	USD	1'000.00	24.10.2016	24.10.2022	34 080 769		-	92.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Nokia Rg	EUR	1'000.00	24.10.2017	24.10.2022	38 310 376	%	71.990	98.810	100.000		0.000	Y
Protection Participation on S&P 500	USD	1'000.00	25.10.2017	25.10.2022	38 486 153	%	100.660	90.310	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	25.10.2017	25.10.2022	38 486 152	%	99.580	93.020	94.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	CHF	1'000.00	25.10.2017	25.10.2022	38 486 151	%	99.660	90.000	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.10.2017	26.10.2022	38 486 230	%	103.740	98.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.10.2017	26.10.2022	38 486 294	%	95.050	90.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	26.10.2017	26.10.2022	38 485 691	%	96.200	98.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.10.2017	26.10.2022	38 485 707	%	99.530	98.960	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.10.2017	26.10.2022	38 486 268	%	99.810	98.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.10.2016	27.10.2022	33 851 394		-	99.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.10.2016	27.10.2022	33 851 398		-	99.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.11.2017	01.11.2022	38 486 288	%	92.840	90.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.11.2017	01.11.2022	38 486 316	%	95.640	98.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	01.11.2017	01.11.2022	38 486 326	%	95.340	94.540	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	02.11.2016	02.11.2022	34 080 439		-	99.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 30.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 88.973%	USD	1'000.00	02.11.2016	02.11.2022	34 080 872		-	92.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.11.2016	02.11.2022	34 080 440	%	93.110	99.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.11.2017	02.11.2022	38 486 287	%	98.590	90.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	11.11.2016	03.11.2022	34 443 834		-	99.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.11.2016	03.11.2022	34 443 833	%	98.820	99.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.11.2017	03.11.2022	38 310 114	%	97.910	98.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	03.11.2017	03.11.2022	38 485 832	%	75.350	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.11.2017	03.11.2022	38 486 367	%	85.280	98.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	04.11.2016	04.11.2022	34 080 530		-	99.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 4.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	07.11.2016	07.11.2022	34 080 911		-	99.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 4.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.11.2016	07.11.2022	34 080 644		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.11.2017	07.11.2022	38 486 381	%	86.960	99.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	07.11.2017	07.11.2022	38 486 292	%	94.060	94.680	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Telefonica Br	EUR	1'000.00	07.11.2017	07.11.2022	38 485 945	%	93.700	98.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	07.11.2017	07.11.2022	38 485 904	%	100.200	90.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.11.2017	07.11.2022	38 485 905	%	99.410	99.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	07.11.2017	07.11.2022	38 486 374	%	96.060	90.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.11.2017	07.11.2022	38 486 315	%	96.990	98.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	07.11.2017	07.11.2022	38 486 361	%	91.690	94.680	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.11.2017	07.11.2022	38 485 869	%	97.890	99.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.11.2017	07.11.2022	38 486 386	%	71.270	99.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 7.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.196%	USD	1'000.00	09.11.2016	09.11.2022	34 443 752		-	92.210	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	09.11.2017	09.11.2022	38 486 035	%	96.840	99.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	09.11.2017	09.11.2022	38 486 036	%	101.420	99.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	09.11.2017	09.11.2022	38 486 034	%	98.830	99.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on EURO iSTOXX 50 Dec 5%	EUR	1'000.00	09.11.2017	09.11.2022	38 486 020	%	97.350	98.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.11.2017	09.11.2022	38 486 341	%	91.620	90.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	09.11.2017	09.11.2022	38 486 409	%	99.970	90.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 8.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	10.11.2016	10.11.2022	34 443 824		-	99.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	10.11.2017	10.11.2022	38 486 342	%	99.560	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.11.2017	14.11.2022	38 486 430	%	78.380	99.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.05.2017	16.11.2022	36 171 404	%	81.340	98.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.11.2017	16.11.2022	38 485 799	%	97.340	90.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 14.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	17.11.2016	17.11.2022	34 080 952		-	98.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.10.2017	17.11.2022	38 486 308	%	95.720	98.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 20.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.784%	GBP	1'000.00	12.04.2017	18.11.2022	36 170 836		-	95.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 20.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.784%	GBP	1'000.00	12.04.2017	18.11.2022	36 170 835		-	95.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 20.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.899%	USD	1'000.00	12.04.2017	18.11.2022	36 170 823		-	89.360	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 20.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.856%	USD	1'000.00	12.04.2017	18.11.2022	36 170 828		-	89.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	24.11.2017	22.11.2022	39 034 314	%	96.210	99.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.11.2017	22.11.2022	39 034 313	%	96.310	99.010	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.11.2017	22.11.2022	39 034 312	%	95.510	99.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	24.11.2017	22.11.2022	39 034 315	%	97.420	99.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.09.2017	23.11.2022	38 126 772	%	95.860	90.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	23.11.2017	23.11.2022	39 034 387	%	98.770	98.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.11.2017	23.11.2022	39 034 311	%	99.600	99.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 24.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 87.163%	USD	1'000.00	18.11.2016	25.11.2022	34 443 841		-	91.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 22.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.557%	GBP	1'000.00	25.11.2016	25.11.2022	34 540 788		-	93.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 23.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.511%	GBP	1'000.00	28.11.2016	28.11.2022	34 443 948		-	93.700	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.11.2017	28.11.2022	39 034 536	%	95.960	90.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.11.2017	28.11.2022	39 034 521	%	101.440	90.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.11.2017	28.11.2022	39 034 535	%	97.070	90.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.11.2017	28.11.2022	39 034 550	%	97.000	90.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.11.2017	28.11.2022	39 034 549	%	100.570	90.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds 27.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 85.348%	USD	1'000.00	29.11.2016	29.11.2022	34 540 808		-	89.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	29.11.2017	29.11.2022	39 164 177	%	96.540	90.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 25.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.548%	GBP	1'000.00	30.11.2016	30.11.2022	34 080 748		-	93.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.11.2017	30.11.2022	39 034 434	%	98.970	89.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.11.2017	30.11.2022	39 034 543	%	98.820	90.130	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	01.12.2016	01.12.2022	34 540 651		-	98.810	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	01.12.2016	01.12.2022	34 540 741	%	106.550	90.950	102.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	02.12.2016	02.12.2022	34 540 660		-	98.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on IBEX 35 30.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	02.12.2016	02.12.2022	34 443 939		-	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 4.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.502%	EUR	1'000.00	13.04.2017	02.12.2022	36 170 837		-	98.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	01.08.2017	02.12.2022	37 420 911	%	105.290	98.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	01.08.2017	02.12.2022	37 420 906	%	103.990	98.410	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	05.12.2016	05.12.2022	34 540 685		-	98.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 3.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 83.186%	USD	1'000.00	09.12.2016	05.12.2022	34 540 684		-	89.390	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	05.12.2017	05.12.2022	39 034 575	%	97.060	90.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 6.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	22.11.2016	06.12.2022	34 443 925		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	06.12.2016	06.12.2022	34 540 860		-	98.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.12.2017	06.12.2022	39 164 192	%	98.170	98.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	06.12.2017	06.12.2022	39 034 591	%	97.980	98.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 7.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 85.646%	USD	1'000.00	07.12.2016	07.12.2022	34 540 833		-	89.580	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	07.12.2016	07.12.2022	34 540 891		-	98.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	05.12.2017	07.12.2022	25 932 963	%	39.480	98.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.12.2017	07.12.2022	39 164 190	%	98.170	89.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 6.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	08.12.2016	08.12.2022	34 540 840		-	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 6.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 84.716%	USD	1'000.00	08.12.2016	08.12.2022	34 540 761		-	88.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	08.12.2016	08.12.2022	33 851 269		-	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.10.2017	08.12.2022	38 310 290	%	98.730	98.670	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	10.10.2017	08.12.2022	38 310 283	%	95.790	98.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.10.2017	08.12.2022	38 310 282	%	98.610	98.720	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	11.10.2017	08.12.2022	38 310 281	%	95.600	90.380	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.10.2017	08.12.2022	38 310 291	%	98.610	90.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on SMI	EUR	1'000.00	09.12.2015	09.12.2022	30 041 195	%	96.730	96.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 7.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	09.12.2016	09.12.2022	34 540 790		-	98.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 7.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	09.12.2016	09.12.2022	34 540 985		-	98.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 9.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	12.12.2016	12.12.2022	34 540 933		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 9.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	12.12.2016	12.12.2022	34 540 932		-	98.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	12.12.2017	12.12.2022	39 164 038	%	97.260	89.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	12.12.2017	12.12.2022	39 164 041	%	98.310	99.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	12.12.2017	12.12.2022	39 164 043	%	98.250	89.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	12.12.2017	12.12.2022	39 164 039	%	98.160	89.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Funds	USD	1'000.00	12.12.2017	12.12.2022	39 164 042	%	97.940	89.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.12.2017	12.12.2022	39 164 036	%	97.490	99.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 13.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.533%	CAD	1'000.00	24.11.2016	13.12.2022	34 443 938		-	91.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	01.06.2017	13.12.2022	36 786 173		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.12.2017	13.12.2022	39 164 051	%	100.980	99.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 12.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 85.214%	USD	1'000.00	14.12.2016	14.12.2022	34 765 619		-	89.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 14.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	16.12.2016	16.12.2022	34 765 593		-	98.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	19.12.2017	19.12.2022	39 164 175	%	97.250	94.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.12.2017	19.12.2022	39 164 119	%	98.500	98.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.12.2017	19.12.2022	39 164 124	%	93.420	98.960	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 16.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	20.12.2016	20.12.2022	34 765 718		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.01.2017	20.12.2022	35 327 796	%	45.240	98.890	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 16.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.062% 16.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	24.01.2017	20.12.2022	35 327 795		-	99.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 19.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung 19.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	21.12.2016	21.12.2022	34 765 759		-	100.000	100.000	19.06.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	21.12.2016	21.12.2022	34 765 725		-	98.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 20.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	21.12.2016	22.12.2022	34 765 831		-	98.390	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Engie 20.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	23.12.2016	22.12.2022	34 902 120		-	98.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Altice A	EUR	1'000.00	22.12.2017	22.12.2022	39 164 114	%	96.930	98.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 23.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	23.12.2016	23.12.2022	34 901 955		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.12.2016	27.12.2022	34 902 240	%	91.550	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 26.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 81.056%	USD	1'000.00	28.12.2016	28.12.2022	34 765 755		-	87.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 27.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	22.12.2016	29.12.2022	34 765 562		-	98.210	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 27.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	22.12.2016	29.12.2022	34 765 563		-	98.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	29.12.2016	29.12.2022	34 902 001		-	98.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.12.2016	30.12.2022	34 902 046		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 28.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	30.12.2016	30.12.2022	34 902 039		-	98.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 28.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.626%	USD	1'000.00	17.01.2017	30.12.2022	35 135 446		-	89.300	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 28.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.934%	USD	1'000.00	03.01.2017	03.01.2023	34 443 792	%	-	87.970	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 27.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.018%	USD	1'000.00	03.01.2017	03.01.2023	34 443 777		-	87.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.07.2017	04.01.2023	37 153 665	%	69.020	98.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	06.12.2017	04.01.2023	39 163 971	%	98.110	98.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	08.12.2016	05.01.2023	34 540 904	%	100.810	88.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	06.12.2017	05.01.2023	39 163 970	%	98.320	89.760	100.000		0.000	Y
Cert. on Equities	CHF	1'000.00	07.01.2013	06.01.2023	19 271 283	%	120.840	72.930	100.000		0.000	Y
Capital Protection 2012-6.1.23 on Equities	CHF	1'000.00	07.01.2013	06.01.2023	19 271 289	%	74.080	72.930	80.000		0.000	Y
Capital Protection 2012-6.1.23 on Equities	CHF	1'000.00	07.01.2013	06.01.2023	19 271 288	%	67.690	82.040	90.000		0.000	Y
Step Cert. 2012-6.1.23 on Equities	CHF	1'000.00	07.01.2013	06.01.2023	19 271 285	%	115.110	82.040	90.000		0.000	Y
Cert. on Equities	CHF	1'000.00	07.01.2013	06.01.2023	19 271 280	%	111.440	86.600	95.000		0.000	Y
Cert. on Equities	CHF	1'000.00	07.01.2013	06.01.2023	19 271 279	%	108.270	91.160	100.000		0.000	Y
Cert. on Equities	CHF	1'000.00	07.01.2013	06.01.2023	19 271 281	%	114.690	82.040	90.000		0.000	Y
Protection-Cert. 2012-6.1.23 on Basket	CHF	1'000.00	07.01.2013	06.01.2023	19 443 244	%	121.650	73.150	80.000		0.000	Y
Capital Protection 2012-6.1.23 on Equities	CHF	1'000.00	07.01.2013	06.01.2023	19 271 287	%	66.060	88.430	97.000		0.000	Y
Step Cert. 2012-6.1.23 on Equities	CHF	1'000.00	07.01.2013	06.01.2023	19 271 284	%	113.730	91.160	100.000		0.000	Y
Protection-Cert. 2012-6.1.23 on Basket	CHF	1'000.00	07.01.2013	06.01.2023	19 443 242	%	114.170	82.040	90.000		0.000	Y
2 % Structured Note on Standard Char 17FRN	EUR	1'000.00	30.10.2015	10.01.2023	29 348 254	%	105.220	100.000	100.000	10.01.	26.126	N
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	29.12.2016	11.01.2023	34 902 011	%	101.040	87.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 10.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 82.889%	USD	1'000.00	29.12.2016	11.01.2023	34 902 010		-	87.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.01.2017	12.01.2023	30 041 237	%	90.440	98.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.01.2017	12.01.2023	35 135 309	%	112.880	98.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.01.2017	12.01.2023	35 135 308	%	104.370	98.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	13.01.2017	13.01.2023	34 443 788	%	107.930	98.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.01.2017	16.01.2023	35 135 087	%	70.830	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	17.01.2017	17.01.2023	34 443 795	%	87.640	94.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 15.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.648%	EUR	1'000.00	17.01.2017	17.01.2023	35 135 110		-	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.626%	EUR	1'000.00	18.01.2017	18.01.2023	34 902 172		-	98.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.626%	EUR	1'000.00	18.01.2017	18.01.2023	34 902 173		-	98.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	18.01.2017	18.01.2023	35 135 172		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	18.01.2017	18.01.2023	35 135 275	%	86.300	94.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 21.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.485%	USD	1'000.00	25.01.2017	25.01.2023	34 443 796		-	89.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 21.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 88.955%	USD	1'000.00	25.01.2017	25.01.2023	35 327 574		-	88.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 21.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.436%	GBP	1'000.00	25.01.2017	25.01.2023	35 327 575		-	94.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.01.2017	25.01.2023	34 443 806	%	63.200	88.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on IBEX 35 24.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.949%	EUR	1'000.00	26.01.2017	26.01.2023	35 135 201		-	98.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BBVA 24.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.949%	EUR	1'000.00	26.01.2017	26.01.2023	35 135 200		-	98.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 27.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	16.01.2017	27.01.2023	35 135 130		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 27.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	16.01.2017	27.01.2023	35 135 128		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Telefonica 25.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.949%	EUR	1'000.00	27.01.2017	27.01.2023	35 135 359		-	98.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.10%	EUR	1'000.00	30.01.2017	30.01.2023	35 327 655		-	98.400	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 28.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.421%	EUR	1'000.00	30.01.2017	30.01.2023	35 327 653		-	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 27.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.838%	EUR	1'000.00	31.01.2017	31.01.2023	35 135 399		-	98.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 31.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.564%	EUR	1'000.00	02.02.2017	02.02.2023	35 327 863		-	98.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.02.2017	02.02.2023	35 327 869	%	97.700	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	02.02.2017	02.02.2023	35 327 871	%	97.350	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.02.2017	02.02.2023	35 448 029	%	89.850	98.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	02.02.2017	02.02.2023	35 327 870	%	96.840	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 2.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.193%	EUR	1'000.00	02.02.2017	02.02.2023	35 327 604		-	98.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.239%	EUR	1'000.00	02.02.2017	02.02.2023	35 327 579		-	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 27.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.239%	EUR	1'000.00	02.02.2017	02.02.2023	35 327 578		-	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 1.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 88.445%	USD	1'000.00	02.02.2017	02.02.2023	35 327 605		-	88.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 4.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	24.01.2017	03.02.2023	35 135 380		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 4.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	24.01.2017	03.02.2023	35 135 384		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.995%	EUR	1'000.00	03.02.2017	03.02.2023	35 327 810		-	98.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 3.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.103%	EUR	1'000.00	03.02.2017	03.02.2023	35 327 809		-	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	03.02.2017	03.02.2023	35 135 450	%	9.900	93.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 4.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.113%	USD	1'000.00	06.02.2015	07.02.2023	25 924 176		-	85.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.66%	EUR	1'000.00	07.02.2017	07.02.2023	35 327 709		-	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 4.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	07.02.2017	07.02.2023	34 443 800		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 5.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 88.07%	USD	1'000.00	09.02.2017	09.02.2023	35 448 101		-	88.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 5.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.45%	EUR	1'000.00	09.02.2017	09.02.2023	35 327 891		-	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 5.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.557% 5.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	09.02.2017	09.02.2023	35 327 978		-	98.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Air Liquide 11.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.884%	EUR	1'000.00	13.02.2017	13.02.2023	35 328 006		-	98.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on IBEX 35 10.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.562%	EUR	1'000.00	14.02.2017	14.02.2023	35 327 946		-	98.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.641%	GBP	1'000.00	13.02.2017	16.02.2023	35 550 818		-	94.360	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.02.2017	16.02.2023	35 327 962	%	117.950	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.02.2017	16.02.2023	35 327 963	%	43.300	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.02.2017	16.02.2023	35 327 996	%	104.080	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 12.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 88.64%	USD	1'000.00	16.02.2017	16.02.2023	35 447 771		-	88.640	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 15.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.36%	EUR	1'000.00	17.02.2017	17.02.2023	35 447 790		-	98.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	17.02.2017	17.02.2023	35 550 919	%	108.290	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	AUD	1'000.00	17.02.2017	17.02.2023	35 327 765	%	94.840	85.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.02.2017	20.02.2023	35 447 823	%	81.680	98.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 18.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.883%	EUR	1'000.00	21.02.2017	21.02.2023	35 328 042		-	98.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.02.2017	21.02.2023	35 447 825	%	83.690	88.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.792%	EUR	1'000.00	21.02.2017	21.02.2023	35 328 043		-	98.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 18.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.773%	EUR	1'000.00	22.02.2017	22.02.2023	35 447 858		-	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 19.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.097%	EUR	1'000.00	23.02.2017	23.02.2023	35 550 908		-	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.571%	USD	1'000.00	23.02.2017	23.02.2023	35 550 984		-	87.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	30.01.2017	27.02.2023	35 327 664	%	103.610	88.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 22.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	27.02.2017	27.02.2023	35 447 930		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 25.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.10%	EUR	1'000.00	27.02.2017	27.02.2023	35 447 799		-	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 24.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.947%	EUR	1'000.00	27.02.2017	27.02.2023	35 447 797		-	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	28.02.2017	28.02.2023	35 327 776	%	103.940	88.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.059%	EUR	1'000.00	28.02.2017	28.02.2023	35 447 938		-	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.03.2017	01.03.2023	35 327 769	%	94.240	88.070	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	02.03.2017	02.03.2023	35 550 986	%	91.880	98.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 1.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 91.384%	USD	1'000.00	02.03.2016	03.03.2023	31 524 393		-	91.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 29.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.623%	EUR	1'000.00	03.03.2017	03.03.2023	35 551 061		-	98.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.03.2017	06.03.2023	35 135 320	%	97.050	98.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Orange	USD	1'000.00	06.03.2017	06.03.2023	35 551 041	%	96.260	88.640	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 1.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 88.34%	USD	1'000.00	06.03.2017	06.03.2023	35 447 927		-	88.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 1.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 88.34% 1.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	06.03.2017	06.03.2023	35 447 926		-	88.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 1.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.19%	EUR	1'000.00	06.03.2017	06.03.2023	35 447 928		-	98.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BNP Paribas-A- 31.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.166%	USD	1'000.00	06.03.2017	06.03.2023	35 551 040		-	88.640	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 1.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.97%	USD	1'000.00	07.03.2017	07.03.2023	35 551 046		-	88.540	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on IBEX 35 6.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.245%	EUR	1'000.00	08.03.2017	08.03.2023	35 447 985		-	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	08.03.2017	08.03.2023	35 327 766	%	93.380	95.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.435%	USD	1'000.00	09.03.2017	09.03.2023	35 550 916		-	87.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 5.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.151%	EUR	1'000.00	09.03.2017	09.03.2023	35 550 414		-	98.450	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 7.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 86.944%	AUD	1'000.00	07.03.2017	10.03.2023	35 550 954		-	85.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	13.03.2017	13.03.2023	35 550 474	%	100.530	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 9.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.84%	EUR	1'000.00	13.03.2017	13.03.2023	35 448 148		-	98.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	08.03.2017	15.03.2023	35 551 088	%	102.010	98.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.888%	EUR	1'000.00	15.03.2017	15.03.2023	35 914 141		-	98.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	15.03.2017	15.03.2023	35 914 115	%	97.350	87.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.03.2017	17.03.2023	30 041 266	%	103.720	87.250	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	17.03.2017	17.03.2023	35 550 610	%	96.860	97.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.03.2017	17.03.2023	30 041 264	%	97.630	97.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.03.2017	17.03.2023	30 041 265	%	103.300	87.250	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.03.2017	20.03.2023	35 550 632	%	101.720	97.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.03.2017	20.03.2023	35 550 637	%	85.470	97.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 19.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 87.787%	USD	1'000.00	21.03.2017	21.03.2023	35 550 520		-	87.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Telefonica Br	EUR	1'000.00	22.03.2017	22.03.2023	35 550 558	%	73.820	98.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Banco Santander Rg 20.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.565%	EUR	1'000.00	22.03.2017	22.03.2023	35 550 559		-	98.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 20.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.644%	EUR	1'000.00	22.03.2017	22.03.2023	35 550 548		-	98.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.617% 21.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	23.03.2017	23.03.2023	35 550 611		-	97.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 28.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	16.03.2017	28.03.2023	35 550 607		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.03.2017	28.03.2023	35 550 671	%	89.000	97.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 26.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.775%	USD	1'000.00	28.03.2017	28.03.2023	35 550 785		-	88.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 28.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.893%	EUR	1'000.00	29.03.2017	29.03.2023	35 550 672		-	97.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 28.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.435%	EUR	1'000.00	06.04.2017	30.03.2023	35 914 260		-	97.700	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	31.07.2017	30.03.2023	37 420 877	%	96.410	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	31.03.2017	31.03.2023	36 171 004	%	97.650	97.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 3.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.606%	EUR	1'000.00	04.04.2017	04.04.2023	30 041 272		-	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 4.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.125%	EUR	1'000.00	05.04.2017	05.04.2023	35 914 391		-	98.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Telefonica Br	EUR	1'000.00	06.04.2017	06.04.2023	35 914 254	%	81.680	97.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.325%	EUR	1'000.00	06.04.2017	06.04.2023	35 550 808		-	97.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	20.09.2017	06.04.2023	38 126 650	%	97.670	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 6.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.36%	EUR	1'000.00	10.04.2017	11.04.2023	35 914 278		-	97.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.04.2017	11.04.2023	35 914 329	%	107.900	97.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Credit Agricole	EUR	1'000.00	10.04.2017	11.04.2023	36 171 024	%	107.690	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	100.00	10.04.2017	11.04.2023	35 914 291	CHF	147.810	94.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.04.2017	11.04.2023	36 170 788	%	87.590	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 11.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.467%	EUR	1'000.00	13.04.2017	13.04.2023	36 171 020		-	97.810	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices 17.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.802%	EUR	1'000.00	19.04.2017	18.04.2023	35 914 393		-	98.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 17.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.654%	EUR	1'000.00	18.04.2017	19.04.2023	35 914 394		-	98.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 17.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.04.2017	19.04.2023	30 041 277		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 17.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.764%	USD	1'000.00	19.04.2017	19.04.2023	36 170 758		-	88.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 17.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.653%	EUR	1'000.00	19.04.2017	19.04.2023	36 170 759		-	98.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.04.2017	20.04.2023	35 914 178	%	99.660	97.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 18.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	20.04.2017	20.04.2023	36 170 870		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 19.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	21.04.2017	21.04.2023	30 041 278		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 23.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.148%	EUR	1'000.00	25.04.2017	25.04.2023	36 170 819		-	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 21.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.986%	GBP	1'000.00	26.04.2017	26.04.2023	36 170 903		-	95.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 21.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.627%	USD	1'000.00	26.04.2017	26.04.2023	36 170 902		-	89.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	26.04.2017	26.04.2023	36 171 042	%	100.280	95.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on EDF	EUR	1'000.00	27.04.2017	27.04.2023	36 171 267	%	105.180	98.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.04.2017	27.04.2023	36 170 885	%	91.540	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 25.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.42%	EUR	1'000.00	27.04.2017	27.04.2023	36 170 917		-	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	28.04.2017	28.04.2023	36 171 036	%	91.650	95.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.05.2017	02.05.2023	30 041 262	%	87.660	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.05.2017	02.05.2023	30 041 261	%	95.910	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	03.05.2017	03.05.2023	36 171 274	%	87.660	89.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 24.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.026%	EUR	1'000.00	03.05.2017	03.05.2023	36 170 899		-	98.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.05.2017	04.05.2023	30 041 279	%	98.880	97.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.148%	EUR	1'000.00	04.05.2017	04.05.2023	36 170 918		-	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.05.2017	04.05.2023	36 170 919	%	98.640	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	04.05.2017	04.05.2023	36 170 980	%	84.230	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 8.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	GBP	1'000.00	10.05.2017	10.05.2023	36 171 333		-	94.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.05.2017	10.05.2023	36 171 524	%	94.510	98.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.05.2017	10.05.2023	30 041 281	%	89.350	98.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.633%	EUR	1'000.00	10.05.2017	10.05.2023	36 171 184		-	98.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	04.05.2017	11.05.2023	36 170 954	%	96.960	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Bouygues	USD	1'000.00	11.05.2017	11.05.2023	36 171 217	%	105.970	88.540	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 14.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	03.05.2017	12.05.2023	36 170 968		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	09.05.2017	12.05.2023	36 170 974	%	90.390	97.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 14.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.106%	USD	1'000.00	09.05.2017	12.05.2023	36 170 973		-	88.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Telefonica Br	EUR	1'000.00	12.05.2017	12.05.2023	36 171 148	%	82.430	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	02.11.2017	15.05.2023	38 485 985	%	98.480	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 17.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.05.2017	17.05.2023	36 171 153		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.05.2017	17.05.2023	36 171 382	%	77.010	97.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	17.05.2017	17.05.2023	36 171 395	%	100.250	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTXBnk EUR P	EUR	1'000.00	18.05.2017	18.05.2023	36 171 213	%	92.170	97.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BBVA Rg	EUR	1'000.00	19.05.2017	19.05.2023	36 171 345	%	90.780	97.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	19.05.2017	19.05.2023	36 171 279	%	89.630	97.930	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.05.2017	19.05.2023	36 171 583	%	97.400	97.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.05.2017	19.05.2023	36 171 582	%	98.250	97.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	22.05.2017	22.05.2023	35 914 134	%	94.580	98.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	22.05.2017	22.05.2023	36 171 448	%	86.180	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.05.2017	23.05.2023	36 171 563	%	85.630	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 21.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.606%	EUR	1'000.00	23.05.2017	23.05.2023	36 171 564		-	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	23.05.2017	24.05.2023	36 171 393	%	84.800	97.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	24.05.2017	24.05.2023	36 171 392	%	87.420	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 22.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.069%	EUR	1'000.00	31.05.2017	24.05.2023	36 171 743		-	98.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	31.05.2017	24.05.2023	36 171 744	%	106.700	98.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 28.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.05.2017	26.05.2023	36 171 167		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 23.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	24.05.2017	26.05.2023	36 171 664		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	26.05.2017	26.05.2023	36 171 677	%	100.370	94.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.05.2017	26.05.2023	36 171 420	%	104.470	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	26.05.2017	26.05.2023	36 171 678	%	87.790	94.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	26.05.2017	26.05.2023	36 171 679	%	102.160	94.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 22.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	26.05.2017	26.05.2023	36 171 620		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 29.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.065%	USD	1'000.00	09.05.2017	30.05.2023	36 171 174		-	88.590	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 29.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.803%	EUR	1'000.00	31.05.2017	31.05.2023	36 171 625		-	98.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	31.05.2017	31.05.2023	36 171 624	%	95.960	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	31.05.2017	31.05.2023	36 171 619	%	112.970	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 31.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	12.05.2017	01.06.2023	36 171 228		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 31.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	12.05.2017	01.06.2023	36 171 229		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 28.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.731%	EUR	1'000.00	01.06.2017	01.06.2023	36 171 430		-	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	01.06.2017	01.06.2023	36 171 629	%	102.920	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	01.06.2017	01.06.2023	36 171 648	%	99.230	98.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	01.06.2017	01.06.2023	36 171 628	%	98.350	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.06.2017	02.06.2023	36 171 730	%	82.080	97.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CAD	1'000.00	18.10.2017	02.06.2023	38 485 531	%	60.360	88.580	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 1.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.937%	EUR	1'000.00	06.06.2017	06.06.2023	36 786 242		-	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 1.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	06.06.2017	06.06.2023	36 786 243		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.06.2017	06.06.2023	30 041 280	%	100.280	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	100.00	07.06.2017	07.06.2023	36 171 585	%	98.980	89.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	07.06.2017	07.06.2023	36 171 499	%	89.120	89.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 1.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.006%	EUR	1'000.00	07.06.2017	07.06.2023	36 786 268		-	98.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 1.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.006%	EUR	1'000.00	07.06.2017	07.06.2023	36 786 269		-	98.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	02.06.2017	09.06.2023	36 171 671	%	90.810	98.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	09.06.2017	09.06.2023	36 786 507	%	90.300	98.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on AXA 7.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.782%	EUR	1'000.00	09.06.2017	09.06.2023	36 786 368		-	98.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	09.06.2017	09.06.2023	36 171 500	%	86.070	94.990	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CAD	1'000.00	20.10.2017	09.06.2023	38 485 577	%	94.700	88.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	20.10.2017	09.06.2023	38 485 575	%	95.530	89.240	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CAD	1'000.00	20.10.2017	09.06.2023	38 485 572	%	95.550	88.650	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	11.06.2015	12.06.2023	28 370 823	%	90.240	94.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	14.06.2017	14.06.2023	36 171 503	%	91.390	89.640	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.06.2017	14.06.2023	36 786 410	%	91.910	98.340	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities 13.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.568%	USD	1'000.00	15.06.2017	15.06.2023	37 046 941		-	89.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 13.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.732%	USD	1'000.00	15.06.2017	15.06.2023	36 786 443		-	89.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	15.06.2017	15.06.2023	36 786 253	%	91.290	98.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 15.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.479%	USD	1'000.00	15.06.2017	15.06.2023	36 786 255		-	89.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.06.2017	16.06.2023	36 786 351	%	102.170	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.06.2017	19.06.2023	36 786 568	%	96.860	98.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.06.2017	19.06.2023	37 046 972	%	93.210	98.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.06.2017	20.06.2023	36 786 599	%	100.250	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.06.2017	21.06.2023	30 041 290	%	89.900	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 19.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	21.06.2017	21.06.2023	30 041 291		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 26.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	09.06.2017	26.06.2023	36 786 270		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 25.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	27.06.2017	27.06.2023	36 786 601		-	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	24.10.2017	28.06.2023	38 485 639	%	98.240	88.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	03.07.2017	03.07.2023	37 047 034	%	88.370	94.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	04.07.2017	04.07.2023	37 153 632	%	57.550	94.770	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on AXA	EUR	1'000.00	30.06.2017	05.07.2023	37 046 643	%	105.230	98.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Daimler N	EUR	1'000.00	30.06.2017	05.07.2023	37 046 645	%	103.830	98.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Engie	EUR	1'000.00	30.06.2017	05.07.2023	37 046 647	%	105.780	98.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BASF N	EUR	1'000.00	30.06.2017	05.07.2023	37 046 649	%	103.260	98.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Casino Guich P	EUR	1'000.00	30.06.2017	05.07.2023	37 046 650	%	98.320	98.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Bouygues	EUR	1'000.00	30.06.2017	05.07.2023	37 046 651	%	104.870	98.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Renault	EUR	1'000.00	30.06.2017	05.07.2023	37 046 642	%	104.980	98.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	30.06.2017	05.07.2023	37 046 640	%	96.250	98.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Total	EUR	1'000.00	30.06.2017	05.07.2023	37 046 641	%	103.470	98.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.07.2017	05.07.2023	37 153 675	%	90.360	98.510	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.747%	EUR	1'000.00	05.07.2017	05.07.2023	37 046 790		-	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.07.2017	05.07.2023	37 046 787	%	91.910	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.07.2017	05.07.2023	37 153 734	%	49.890	97.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.07.2017	05.07.2023	37 153 735	%	52.400	97.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.747%	EUR	1'000.00	05.07.2017	05.07.2023	37 046 788		-	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.031%	EUR	1'000.00	06.07.2017	06.07.2023	37 153 754		-	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.07.2017	06.07.2023	37 046 789	%	87.680	89.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.031%	EUR	1'000.00	06.07.2017	06.07.2023	37 153 753		-	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 2.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.04%	USD	1'000.00	06.07.2017	06.07.2023	37 046 791		-	89.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 9.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	15.06.2017	07.07.2023	36 786 551		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 28.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.809%	USD	1'000.00	07.07.2017	07.07.2023	37 046 739		-	89.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.07.2017	07.07.2023	37 046 817	%	111.830	97.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket 6.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.164%	USD	1'000.00	07.07.2017	07.07.2023	37 046 673		-	89.320	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	07.07.2017	07.07.2023	37 046 672	%	93.300	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	07.07.2017	07.07.2023	37 046 818	%	93.910	97.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	07.07.2017	07.07.2023	37 047 025	%	94.680	88.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	11.07.2017	11.07.2023	36 170 988	%	97.050	93.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.07.2017	11.07.2023	37 153 775	%	99.020	97.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 10.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.196%	EUR	1'000.00	30.06.2017	12.07.2023	37 046 737		-	98.500	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	12.07.2017	12.07.2023	36 171 510	%	95.190	88.430	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	12.07.2017	12.07.2023	37 046 784	%	96.490	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.07.2017	13.07.2023	37 046 822	%	96.490	97.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.07.2017	14.07.2023	37 153 774	%	99.050	97.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Societe Generale	EUR	1'000.00	14.07.2017	14.07.2023	37 046 916	%	81.440	97.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Veolia Environnem.	EUR	1'000.00	14.07.2017	14.07.2023	37 046 915	%	105.680	97.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 17.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	27.06.2017	17.07.2023	37 046 698		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	28.06.2017	17.07.2023	37 046 697		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	17.07.2017	17.07.2023	37 046 851	%	95.020	97.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	18.07.2017	18.07.2023	36 171 519	%	96.770	97.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.07.2017	18.07.2023	37 153 787	%	103.180	97.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Bouygues	EUR	1'000.00	18.07.2017	18.07.2023	37 153 669	%	101.680	97.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.07.2017	18.07.2023	37 153 668	%	92.200	97.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	18.07.2017	18.07.2023	37 153 667	%	97.220	97.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.07.2017	18.07.2023	37 153 786	%	105.620	97.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 19.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.06.2017	19.07.2023	37 046 740		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	20.07.2017	20.07.2023	37 046 895	%	95.160	97.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	20.07.2017	20.07.2023	30 041 304	%	102.030	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	100.00	20.07.2017	20.07.2023	37 153 772	%	92.750	88.740	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	20.07.2017	20.07.2023	37 046 894	%	95.150	97.460	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	15.12.2017	20.07.2023	39 164 086	%	96.520	88.440	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	27.07.2017	27.07.2023	36 171 288	%	92.270	89.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.07.2017	27.07.2023	37 421 033	%	95.350	97.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Total	EUR	1'000.00	27.07.2017	27.07.2023	37 153 879	%	101.970	97.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	27.07.2017	27.07.2023	37 420 839	%	100.530	94.370	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	12.07.2017	31.07.2023	37 046 881		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	31.07.2017	31.07.2023	36 171 738	%	101.680	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	01.08.2017	01.08.2023	36 171 289	%	88.580	89.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	01.08.2017	01.08.2023	37 153 836	%	101.250	97.230	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 1.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	19.07.2017	02.08.2023	37 046 900		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	03.08.2017	03.08.2023	37 420 857	%	100.070	89.060	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.08.2017	03.08.2023	37 420 895	%	94.780	97.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	03.08.2017	03.08.2023	36 171 522	%	97.560	97.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	04.08.2017	04.08.2023	36 171 290	%	97.490	88.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 26.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.748%	EUR	1'000.00	04.08.2017	04.08.2023	37 421 017		-	97.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 7.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 88.946%	USD	1'000.00	09.08.2017	09.08.2023	37 421 076		-	89.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 7.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	09.08.2017	09.08.2023	37 421 075		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.956%	EUR	1'000.00	09.08.2017	09.08.2023	37 420 930		-	97.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.08.2017	10.08.2023	37 421 094	%	76.880	97.760	100.000	17.08.	0.070	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	10.08.2017	10.08.2023	37 421 014	%	94.880	89.110	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Telefonica Br	EUR	1'000.00	10.08.2017	10.08.2023	37 420 939	%	83.510	97.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	11.08.2017	11.08.2023	36 171 517	%	98.070	97.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 9.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.425%	EUR	1'000.00	11.08.2017	11.08.2023	37 643 937		-	97.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	16.08.2017	16.08.2023	37 643 907	%	96.000	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.08.2017	16.08.2023	37 749 650	%	102.130	89.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	16.08.2017	16.08.2023	37 420 923	%	93.850	97.520	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	16.08.2017	16.08.2023	37 749 502	%	98.070	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	16.08.2017	16.08.2023	37 643 955	%	93.630	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.667%	GBP	1'000.00	16.08.2017	16.08.2023	37 643 946		-	94.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 17.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	08.08.2017	21.08.2023	37 420 883		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	21.08.2017	21.08.2023	37 644 058	%	97.510	94.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.08.2017	21.08.2023	37 643 982	%	97.330	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.08.2017	21.08.2023	37 643 981	%	108.150	98.040	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.08.2017	21.08.2023	37 643 983	%	107.060	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.08.2017	21.08.2023	37 643 980	%	101.730	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	22.08.2017	22.08.2023	36 171 292	%	90.110	94.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.08.2017	24.08.2023	37 644 032		-	97.930	100.000		0.000	Y
22.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.62%												
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	24.08.2017	24.08.2023	37 644 033	%	78.220	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.08.2017	25.08.2023	37 749 727	%	91.220	89.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.08.2017	25.08.2023	37 749 521	%	100.980	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.08.2017	25.08.2023	37 749 522	%	105.860	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	25.08.2017	25.08.2023	37 749 512	%	99.860	94.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	25.08.2017	25.08.2023	36 171 293	%	101.020	94.880	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	25.08.2017	25.08.2023	36 171 301	%	100.940	89.270	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Klepierre	EUR	1'000.00	30.08.2017	30.08.2023	37 749 572	%	102.900	98.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Carrefour	EUR	1'000.00	31.08.2017	31.08.2023	37 749 595	%	84.230	98.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	01.09.2017	01.09.2023	30 041 311	%	89.670	97.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	04.09.2017	04.09.2023	36 171 516	%	99.910	94.940	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Bouygues	EUR	1'000.00	05.09.2017	05.09.2023	37 749 790	%	101.040	98.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.09.2017	06.09.2023	37 749 821	%	94.130	98.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.09.2017	06.09.2023	37 749 803	%	71.370	98.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	07.09.2017	07.09.2023	37 749 755	%	95.040	89.640	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Carrefour	EUR	1'000.00	07.09.2017	07.09.2023	37 749 907	%	99.540	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on AXA	EUR	1'000.00	11.09.2017	11.09.2023	37 749 935		-	98.280	100.000		0.000	Y
7.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.184%												
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	12.09.2017	12.09.2023	38 126 815	%	99.670	90.010	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.09.2017	13.09.2023	38 126 596	%	101.690	98.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	15.09.2017	13.09.2023	38 126 849	%	99.670	89.540	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.09.2017	14.09.2023	38 126 833	%	100.040	89.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	14.09.2017	14.09.2023	38 126 834	%	97.920	98.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	14.09.2017	14.09.2023	37 749 858	%	97.200	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.09.2017	15.09.2023	37 644 070	%	94.770	89.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.09.2017	15.09.2023	30 041 332	%	93.560	98.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.09.2017	15.09.2023	38 126 610	%	74.280	98.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.09.2017	15.09.2023	37 644 069	%	95.250	89.530	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.09.2017	15.09.2023	38 126 697	%	98.020	98.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.09.2017	18.09.2023	38 126 857		-	98.340	100.000		0.000	Y
14.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.282%												
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.09.2017	18.09.2023	38 126 805	%	97.970	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	18.09.2017	18.09.2023	38 126 659		-	89.740	100.000		0.000	Y
14.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.571%												
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.09.2017	18.09.2023	38 126 804	%	106.100	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.09.2017	19.09.2023	38 126 868	%	92.010	98.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	19.09.2017	19.09.2023	38 126 864	%	93.800	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	19.09.2017	19.09.2023	37 749 993	%	96.150	98.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	19.09.2017	19.09.2023	38 126 593	%	99.200	98.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.09.2017	19.09.2023	38 126 654	%	84.050	98.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	19.09.2017	19.09.2023	30 041 337	%	100.640	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.09.2017	21.09.2023	38 126 722	%	103.560	98.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	22.09.2017	22.09.2023	30 041 293	%	96.890	98.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	22.09.2017	22.09.2023	38 126 759	%	94.910	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	25.09.2017	25.09.2023	38 126 871	%	91.410	93.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	25.09.2017	25.09.2023	38 126 653	%	94.740	98.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Schneider E.SE	EUR	1'000.00	26.09.2017	26.09.2023	38 126 677	%	93.600	98.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Total	EUR	1'000.00	26.09.2017	26.09.2023	38 126 676	%	97.050	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Veolia Environnem.	EUR	1'000.00	26.09.2017	26.09.2023	38 126 678	%	97.520	98.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	26.09.2017	26.09.2023	38 126 688	%	100.000	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Carrefour	EUR	1'000.00	26.09.2017	26.09.2023	38 126 679	%	97.450	98.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.09.2017	28.09.2023	30 041 346	%	102.560	97.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.09.2017	28.09.2023	38 310 153		-	97.690	100.000		0.000	Y
28.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.233%												
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.09.2017	28.09.2023	38 310 152		-	88.800	100.000		0.000	Y
26.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 88.317%												

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Basket 28.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.162%	USD	1'000.00	29.08.2017	29.09.2023	37 749 750		-	89.180	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	29.09.2017	29.09.2023	38 309 927	%	101.160	97.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Bouygues	EUR	1'000.00	29.09.2017	29.09.2023	38 309 928	%	103.150	97.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 22.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	02.10.2017	02.10.2023	38 126 890		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.10.2017	02.10.2023	38 126 971	%	91.370	97.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.10.2017	02.10.2023	38 310 083	%	90.860	88.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	02.10.2017	02.10.2023	38 309 941	%	98.540	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	02.10.2017	02.10.2023	38 309 949	%	96.440	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	03.10.2017	04.10.2023	38 310 191	%	99.650	93.150	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	04.10.2017	04.10.2023	38 310 003	%	96.130	88.590	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	04.10.2017	04.10.2023	38 310 184	%	93.240	88.640	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.10.2017	05.10.2023	38 310 006	%	97.190	97.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.10.2017	05.10.2023	38 310 010	%	103.070	97.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	05.10.2017	05.10.2023	38 126 964	%	100.940	97.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	05.10.2017	05.10.2023	38 126 963	%	96.200	97.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	05.10.2017	05.10.2023	38 126 965	%	95.710	88.740	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	05.10.2017	05.10.2023	38 126 744	%	96.930	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	05.10.2017	05.10.2023	38 310 008	%	87.290	97.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	22.09.2017	06.10.2023	38 126 647	%	100.540	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	06.10.2017	06.10.2023	38 310 072	%	76.330	93.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	06.10.2017	06.10.2023	38 310 075	%	89.620	93.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	06.10.2017	06.10.2023	38 310 166	%	80.010	93.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	06.10.2017	06.10.2023	38 310 073	%	94.890	93.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	19.09.2017	09.10.2023	38 126 715	%	101.100	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	10.10.2017	10.10.2023	38 486 138	%	69.160	97.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on MSCI ITALY Index	EUR	1'000.00	10.10.2017	10.10.2023	38 310 243	%	89.100	97.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	10.10.2017	10.10.2023	38 126 901	%	96.730	97.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTXBnk EUR P	EUR	1'000.00	10.10.2017	10.10.2023	38 126 902	%	95.800	97.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.10.2017	10.10.2023	38 310 158	%	101.120	88.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.10.2017	10.10.2023	38 486 175	%	96.450	97.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	11.10.2017	11.10.2023	38 310 257	%	98.790	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	12.10.2017	12.10.2023	38 310 034	%	95.660	97.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	12.10.2017	12.10.2023	37 644 082	%	98.290	88.590	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	12.10.2017	12.10.2023	38 310 258	%	101.200	88.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	12.10.2017	12.10.2023	38 310 088	%	98.280	93.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	13.09.2017	13.10.2023	38 126 605	%	100.330	89.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	26.09.2017	13.10.2023	38 126 888	%	102.570	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.10.2017	13.10.2023	38 485 527	%	91.580	88.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.10.2017	13.10.2023	38 485 528	%	92.990	88.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CAD	1'000.00	17.10.2017	13.10.2023	38 485 530	%	96.500	87.830	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.10.2017	13.10.2023	38 485 529	%	98.730	88.450	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	11.10.2017	16.10.2023	38 310 007	%	88.940	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Credit Agricole	EUR	1'000.00	16.10.2017	16.10.2023	38 310 359	%	88.650	97.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.10.2017	16.10.2023	38 486 144	%	55.530	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.09.2017	17.10.2023	38 126 696	%	89.230	98.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Total	EUR	1'000.00	17.10.2017	17.10.2023	38 310 263	%	97.980	97.630	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on EURO iSTOXX 50	EUR	1'000.00	18.10.2017	18.10.2023	38 485 532	%	94.280	97.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.10.2017	18.10.2023	30 041 355	%	100.020	97.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	18.10.2017	18.10.2023	38 486 217	%	101.200	97.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	18.10.2017	18.10.2023	38 486 156	%	80.300	88.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.10.2017	19.10.2023	38 310 312	%	97.700	97.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	19.10.2017	19.10.2023	38 310 317	%	95.640	97.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 16.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 88.619%	USD	1'000.00	19.10.2017	19.10.2023	38 310 160		-	88.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 16.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.719%	EUR	1'000.00	19.10.2017	19.10.2023	38 310 162		-	97.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 16.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 88.619%	USD	1'000.00	19.10.2017	19.10.2023	38 310 161		-	88.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.10.2017	19.10.2023	38 310 084	%	90.120	88.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.10.2017	19.10.2023	38 485 558	%	100.930	88.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.10.2017	19.10.2023	38 485 544	%	92.300	97.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.10.2017	19.10.2023	38 310 313	%	92.310	97.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.10.2017	19.10.2023	38 310 270	%	90.400	97.690	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Carrefour	EUR	1'000.00	20.10.2017	20.10.2023	38 485 586	%	98.560	97.870	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Engie	USD	1'000.00	23.10.2017	23.10.2023	38 310 358	%	98.920	88.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	23.10.2017	23.10.2023	30 041 375	%	99.400	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	23.10.2017	23.10.2023	38 486 259	%	98.340	88.540	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Volkswagen Vz I	EUR	1'000.00	24.10.2017	24.10.2023	38 310 375	%	101.410	97.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.10.2017	25.10.2023	38 486 282	%	88.300	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	25.10.2017	25.10.2023	38 486 177	%	94.190	88.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	25.10.2017	25.10.2023	38 485 672	%	95.570	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.10.2017	25.10.2023	38 485 632	%	101.740	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.10.2017	25.10.2023	38 485 670	%	89.590	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on EDF	CHF	1'000.00	25.10.2017	25.10.2023	38 485 651	%	90.390	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	26.10.2017	26.10.2023	38 126 808	%	92.850	88.380	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	26.10.2017	26.10.2023	38 485 533	%	82.560	97.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	26.10.2017	26.10.2023	38 485 692	%	95.450	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	27.10.2017	27.10.2023	38 486 232	%	101.310	88.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 23.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.718%	EUR	1'000.00	27.10.2017	27.10.2023	38 486 231		-	97.690	100.000	23.11.	0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.10.2017	30.10.2023	38 485 746	%	86.990	97.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.10.2017	30.10.2023	38 485 745	%	95.490	97.750	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	11.10.2017	31.10.2023	38 310 316	%	100.090	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	31.10.2017	31.10.2023	38 485 955	%	97.950	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	31.10.2017	31.10.2023	38 486 235	%	100.390	97.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.10.2017	31.10.2023	38 486 234	%	86.840	88.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.10.2017	31.10.2023	38 486 340	%	94.690	87.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 30.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 87.912%	USD	1'000.00	01.11.2017	01.11.2023	38 486 236		-	87.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	01.11.2017	01.11.2023	38 485 661	%	99.470	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	02.11.2017	02.11.2023	38 485 988	%	101.670	87.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	03.11.2017	03.11.2023	38 486 272	%	99.180	93.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 4.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.224%	EUR	1'000.00	04.11.2015	06.11.2023	29 348 113		-	93.820	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.10.2017	07.11.2023	38 485 561	%	100.920	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Easyjet Rg	EUR	1'000.00	07.11.2017	07.11.2023	38 486 377	%	99.820	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 5.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.006%	EUR	1'000.00	07.11.2017	07.11.2023	38 486 376		-	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.11.2017	07.11.2023	30 041 414	%	99.020	88.210	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.11.2017	07.11.2023	30 041 415	%	99.150	88.210	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	09.11.2017	09.11.2023	38 486 411	%	95.780	88.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	10.11.2017	10.11.2023	38 485 984	%	96.050	97.630	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.11.2017	10.11.2023	38 486 422	%	98.910	88.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.11.2017	13.11.2023	38 486 434	%	101.430	88.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.11.2017	13.11.2023	38 486 433	%	96.710	98.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	13.11.2017	13.11.2023	38 486 431	%	95.230	98.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	16.11.2017	13.11.2023	38 486 426	%	97.070	98.100	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	15.11.2017	15.11.2023	38 486 238	%	98.860	98.160	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 13.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 88.421%	USD	1'000.00	15.11.2017	15.11.2023	39 034 361		-	88.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.11.2017	16.11.2023	38 486 383	%	98.250	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	16.11.2017	16.11.2023	38 486 239	%	101.620	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	30.10.2017	17.11.2023	38 486 108	%	99.460	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	17.11.2017	17.11.2023	38 486 048	%	90.120	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.11.2017	17.11.2023	30 041 379	%	97.030	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	01.11.2017	20.11.2023	38 485 958	%	100.500	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.11.2017	20.11.2023	38 486 055	%	97.570	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	20.11.2017	20.11.2023	38 486 467	%	92.590	88.020	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	20.11.2017	20.11.2023	39 034 362	%	90.110	87.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	20.11.2017	20.11.2023	38 486 375	%	88.330	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Engie	USD	1'000.00	20.11.2017	20.11.2023	38 485 795	%	98.380	88.330	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTXBnk EUR P	EUR	1'000.00	21.11.2017	21.11.2023	38 486 414	%	98.470	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	21.11.2017	21.11.2023	38 486 495	%	102.310	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	22.11.2017	22.11.2023	39 034 518	%	102.760	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.11.2017	22.11.2023	39 034 520	%	96.290	88.170	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	100.00	22.11.2017	23.11.2023	39 034 548	CHF	116.370	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	24.11.2017	24.11.2023	39 034 540	%	100.630	87.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.11.2017	28.11.2023	39 034 493	%	91.870	98.040	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.11.2017	28.11.2023	39 034 522	%	97.770	87.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	28.11.2017	28.11.2023	38 310 106	%	97.490	93.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	28.11.2017	28.11.2023	39 034 498	%	87.380	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	28.11.2017	28.11.2023	38 310 105	%	98.090	93.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on AXA	EUR	1'000.00	29.11.2017	29.11.2023	39 034 436	%	89.820	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.11.2017	29.11.2023	39 034 523	%	96.330	87.860	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	29.11.2017	29.11.2023	38 486 387	%	97.760	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	29.11.2017	29.11.2023	39 034 461	%	101.080	87.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.11.2017	30.11.2023	38 485 813	%	98.470	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.11.2017	30.11.2023	39 034 433	%	98.010	87.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	30.11.2017	30.11.2023	39 034 524	%	102.690	87.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	30.11.2017	30.11.2023	39 034 325	%	94.190	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	01.12.2017	01.12.2023	39 034 376	%	92.130	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	01.12.2017	01.12.2023	39 034 403	%	98.660	87.910	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on HSBC Hldg Rg	EUR	1'000.00	04.12.2017	04.12.2023	39 034 468	%	88.020	97.930	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	04.12.2017	04.12.2023	39 164 173	%	95.120	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	07.11.2017	05.12.2023	38 485 894	%	99.410	97.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	05.12.2017	05.12.2023	39 034 577	%	98.520	88.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.12.2017	06.12.2023	39 164 205	%	97.460	87.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	06.12.2017	06.12.2023	39 034 372	%	94.690	87.810	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	07.12.2017	07.12.2023	39 164 206	%	98.770	93.090	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	07.12.2017	07.12.2023	39 034 384	%	96.490	87.760	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	07.12.2017	07.12.2023	39 034 324	%	98.150	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	21.11.2017	08.12.2023	39 034 340	%	99.590	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	08.12.2017	08.12.2023	39 164 006	%	97.920	93.200	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	08.12.2017	08.12.2023	39 164 005	%	97.770	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	08.12.2017	08.12.2023	39 034 402	%	97.420	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on EDF	USD	1'000.00	11.12.2015	11.12.2023	30 041 200	%	73.860	85.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Engie	USD	1'000.00	11.12.2015	11.12.2023	30 041 199	%	90.410	85.280	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	11.12.2017	11.12.2023	39 034 508	%	98.410	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.12.2017	11.12.2023	39 034 525	%	100.370	87.550	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	19.12.2017	19.12.2023	39 034 590	%	95.780	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	19.12.2017	19.12.2023	39 034 385	%	95.450	87.400	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	19.12.2017	19.12.2023	39 164 325	%	96.800	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.12.2017	19.12.2023	39 164 225	%	97.900	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	19.12.2017	19.12.2023	39 164 118	%	90.370	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	19.12.2017	19.12.2023	39 034 589	%	95.130	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.12.2017	20.12.2023	39 034 526	%	100.490	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.12.2017	20.12.2023	30 041 497	%	97.320	97.870	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Gold 1 Uz	USD	1'000.00	21.03.2017	21.12.2023	35 914 181	%	88.610	81.320	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	21.12.2017	21.12.2023	39 164 240	%	98.110	87.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	21.12.2017	21.12.2023	39 164 162	%	97.630	87.710	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	21.12.2017	21.12.2023	39 164 161	%	98.170	87.610	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	GBP	1'000.00	10.10.2017	22.12.2023	38 486 134	%	98.480	93.210	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Bouygues	EUR	1'000.00	15.12.2017	22.12.2023	39 164 089	%	97.440	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on AIR France - KLM	EUR	1'000.00	15.12.2017	22.12.2023	39 164 088	%	99.500	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Renault	EUR	1'000.00	15.12.2017	22.12.2023	39 164 090	%	98.140	97.980	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.12.2017	22.12.2023	39 164 257	%	100.070	87.660	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	22.12.2017	22.12.2023	30 041 499	%	99.830	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	27.12.2017	27.12.2023	39 164 296	%	99.000	87.350	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	27.12.2017	27.12.2023	39 164 122	%	98.260	97.930	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	EUR	1'000.00	27.12.2017	27.12.2023	39 164 045	%	97.360	98.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	07.12.2017	04.01.2024	39 164 212	%	97.830	87.620	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	22.12.2017	10.01.2024	39 164 256	%	97.770	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 26.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.78%	EUR	1'000.00	28.01.2016	29.01.2024	30 498 008		-	95.480	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	04.09.2017	25.03.2024	37 749 767	%	95.830	97.610	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	16.06.2017	17.06.2024	36 171 731	%	96.920	97.310	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 10.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	12.07.2016	12.07.2024	32 829 609		-	99.050	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P 13.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	13.07.2016	15.07.2024	32 829 611		-	99.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Total	EUR	1'000.00	15.09.2017	16.09.2024	38 126 803	%	95.330	97.040	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	07.03.2017	04.10.2024	35 551 073	%	104.760	97.540	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Schneider E.SE	USD	1'000.00	28.11.2017	29.11.2024	39 164 184	%	99.570	85.570	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	24.03.2015	09.04.2025	27 339 372	%	110.220	94.080	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Basket	CHF	1'000.00	26.06.2015	11.07.2025	27 992 888	%	98.170	97.270	100.000	11.07.	50.000	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	03.11.2017	10.09.2025	38 486 350	%	94.970	94.970	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Bouygues	EUR	1'000.00	17.10.2017	17.10.2025	38 486 207	%	100.330	94.800	100.000		0.000	Y
ENBW Energie Baden-Wuerttemberg AG, Karlsruhe, Deutschland												
Notes Variable Rate Subord. 2.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	20.09.2011	02.04.2072	14 183 401		-	100.000	100.000	02.04.	78.801	N
ENERTRAG Aktiengesellschaft, Dauerthal, Deutschland												
7 % auf HVPI	EUR	500.00	01.10.2010	02.01.2017	12 246 643		-	100.000	100.000	02.01.	14.210	N
Erste Group Bank AG, Wien, Österreich												
Bonitaetsabhaengige lineare Anleihe mit Kreditrisiko auf Deutsche Bank,Metro,RWE	EUR	1'000.00	12.03.2014	20.10.2019	23 932 632	%	104.370	100.000	100.000	20.10.	34.777	N
Exane Finance, Paris, Frankreich												
Yield Crescendo Certificate (exp.13.3.17) on a Basket of Shares	CHF	1'000.00	27.03.2014	20.03.2017	23 727 964		-	99.499	100.000		0.000	Y
Yield Crescendo Tempo certificates on a basket of shares	CHF	1'000.00	14.05.2014	16.05.2017	24 172 146		-	99.570	100.000		0.000	Y
Yield Crescendo Tempo Certificate on a basket of shares	CHF	1'000.00	07.11.2014	07.11.2017	25 648 488		-	99.865	100.000	07.11.	60.000	Y
Reverse Convertible on Equities 6.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	05.06.2015	05.06.2018	28 110 525		-	100.000	100.000		0.000	Y
Yield Crescendo Tempo certificate on a basket of shares	CHF	1'000.00	13.08.2015	13.08.2018	28 995 081	%	101.510	100.000	100.000		0.000	Y
2.2 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	30.09.2016	01.10.2018	32 376 011	%	107.980	100.000	100.000	02.10.	0.000	N
3.65 % Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	05.10.2016	05.10.2018	32 376 012	%	110.070	100.000	100.000	05.10.	0.000	N
Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	14.12.2015	13.12.2018	30 415 240	%	100.180	100.000	100.000		0.000	Y
Bonds Certificates on a Basket of Bonds	SEK	100'000.00	22.04.2014	30.04.2019	24 050 053	%	90.780	100.000	100.000	02.05. 30.10.	309.52 327.94	N
Phoenix Memory on a Basket of indexes	EUR	1'000.00	17.03.2015	17.03.2020	27 201 508	%	100.580	98.589	100.000		0.000	Y
Certificate on a Basket of Bond and Index	CHF	1'000.00	29.03.2012	15.09.2022	18 298 541	%	97.690	101.000	100.000		0.000	Y
Certificate on BTP 5.5% 1.9.22	CHF	1'000.00	29.03.2012	15.09.2022	18 298 533	%	100.610	101.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Bonds	EUR	1'000.00	09.04.2015	29.10.2025	27 600 898	%	103.760		100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Glencore Finance Canada Ltd, York, Kanada												
Notes Sr Lkd to Rating Changes Reg S	USD	1'000.00	25.10.2012	25.10.2022	19 871 655	%	104.450	99.747	100.000	25.04. 25.10.	21.108 21.037	N
Goldman Sachs & Co. Wertpapier GmbH, Frankfurt, Deutschland												
9.7 % Reverse Convertible auf Aktien	CHF	5'000.00	22.01.2016	20.01.2017	29 386 628		-	100.000	100.000	20.01.	0.000	Y
5 % Kick-In GOAL auf Aktien-Basket	CHF	1'000.00	28.01.2016	30.01.2017	30 863 994		-	100.000	100.000	30.01.	0.000	N
Bonus Certificates on a Basket of Indices	EUR	1'000.00	10.02.2014	10.02.2017	22 861 211		-	97.923	100.000		0.000	Y
Worst Of Autocallable Certificates Variable Rate on a Basket of Shs	USD	1'000.00	14.02.2014	01.03.2017	23 266 701		-	97.576	100.000		0.000	Y
10.2 % Reverse Convertible auf Tahoe Res	USD	1'000.00	02.03.2016	03.03.2017	31 498 661		-	100.000	100.000	03.03.	11.700	Y
Leveraged Bonus Certificates on Hong Kong Hang Seng Index	USD	1'000.00	14.03.2014	14.03.2017	23 776 960		-	97.545	100.000		0.000	Y
Participation Notes auf Basket	USD	1'000.00	07.04.2014	07.04.2017	24 034 847		-	96.958	100.000		0.000	Y
Participation Notes auf Basket	USD	1'000.00	07.04.2014	07.04.2017	24 034 846		-	96.958	100.000		0.000	Y
1 % (4 % P.A.) Autocallable Certificates on a Basket of Indices	CHF	1'000.00	09.04.2015	07.04.2017	27 062 235		-	100.000	100.000	11.01. 07.04.	0.000 0.000	N
Capital Protected Notes on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	24.06.2014	26.06.2017	23 824 629		-	96.996	100.000		0.000	Y
Outperformance-Zert. auf STX HDLB 50 EUR P	EUR	1'000.00	26.06.2015	26.06.2017	28 120 358		-	99.729	100.000		0.000	Y
Barrier Reverse Convertible-Zert. auf Euro Stoxx 50-Index	EUR	1'000.00	07.08.2015	07.08.2017	28 514 977		-	100.000	100.000	07.02. 07.05. 07.08.	0.26917 0.27531 0.28961	N
Market Timer Certificates on Stoxx Europe 600 Index	EUR	1'000.00	12.02.2014	15.08.2017	23 636 582		-	97.352	100.000		0.000	Y
Reverse Bonus Certificates on DAX Index	EUR	100.00	01.10.2014	02.10.2017	25 012 442		-	99.172	100.000		0.000	Y
Regd.Bonus Certificates on GS Enhanced Strategy A18 Index	EUR	1'000.00	16.12.2014	16.12.2017	25 323 070		-	99.203	100.000		0.000	Y
Bonus-Zert. auf GOSA Enhanced Strategy A18	USD	1'000.00	16.12.2014	18.12.2017	25 323 083		-	96.388	100.000		0.000	Y
5.3 % Reverse Convertible auf Indizes 12.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	12.01.2017	12.01.2018	34 108 071		-	100.000	100.000	12.04. 12.07.	4.243 4.071	N
8.8 % Reverse Convertible auf Aktien 2.11.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	02.02.2017	02.02.2018	34 735 966		-	100.000	100.000	04.05. 03.08. 02.11.	0.000 0.000 0.000	N
9.2 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.04.2017	06.04.2018	35 911 424	%	105.800	100.000	100.000		0.000	Y
7.6 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	06.04.2017	06.04.2018	35 911 426	%	104.430	100.000	100.000		0.000	Y
Outperformance-Zert. auf Intern Dividend StarsNetRetur	EUR	104.00	20.04.2015	20.04.2018	27 664 219	CHF	120.230	99.700	100.000		0.000	Y
7.1 % Reverse Convertible auf Aktien	EUR	1'000.00	01.03.2017	30.04.2018	34 108 093	%	58.290	100.000	100.000		0.000	Y
Multi Barrier Reverse Convertible on Basket of Indices	GBP	1'000.00	27.12.2013	25.06.2018	23 124 835	%	99.800	92.609	100.000		0.000	Y
7 % Reverse Convertible auf Daimler N	EUR	1'000.00	26.01.2017	26.07.2018	34 108 067	%	100.840	100.000	100.000	26.04. 26.07. 26.10.	0.000 0.000 0.000	N
Underlying Tracker auf Indizes	USD	1'000.00	06.08.2015	07.08.2018	28 230 733	%	93.100	96.166	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	08.11.2017	08.08.2018	38 844 262	%	100.580	93.804	95.000		0.000	Y
Market Timer Certificates on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	13.08.2014	13.08.2018	24 970 305	CHF	1386.620	97.976	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities Series M	USD	1'000.00	27.02.2017	24.08.2018	35 341 838	%	101.540	98.270	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf EM	USD	1'000.00	21.04.2016	22.10.2018	31 864 656	CHF	1352.570	97.776	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Basket	USD	1'000.00	23.04.2015	23.10.2018	27 062 373	CHF	756.190	95.839	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 27.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.175%	GBP	1'000.00	27.10.2015	29.10.2018	29 170 116		-	93.121	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices Series M 15.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.06%	USD	1'000.00	18.11.2016	16.11.2018	34 127 420		-	97.800	100.000		0.000	Y
Marker Timer-Zert. auf S&P 500-Index	USD	100.00	05.12.2014	05.12.2018	25 975 152	CHF	126.620	94.512	100.000		0.000	Y
Bonus-Zert. auf GOSA Enhanced Strategy A18	USD	1'000.00	08.12.2015	06.12.2018	29 386 350	CHF	1142.370	96.236	100.000		0.000	Y
Notes auf Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	06.07.2015	09.01.2019	28 409 349	%	99.870	95.249	100.000		0.000	Y
Partizipation Notes auf Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	21.07.2015	22.01.2019	25 320 731	%	98.060	95.283	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
5 % Reverse Convertible auf Allianz N 25.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	25.01.2017	25.01.2019	34 108 068		-	100.000	100.000	25.04. 25.07.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible auf Aktien 13.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	13.03.2017	13.03.2019	34 108 104		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Gold 1 Uz PM Fix	USD	1'000.00	05.04.2016	05.04.2019	31 498 989	CHF	1046.970	96.722	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	06.04.2017	08.04.2019	35 911 436	%	103.400	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	06.04.2017	08.04.2019	35 911 433	%	105.450	96.845	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Euro Stoxx 50	USD	1'000.00	25.04.2017	24.04.2019	35 911 722	%	103.610	96.921	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on STXE6Bnk EUR P S eries M	USD	1'000.00	24.05.2017	24.05.2019	35 912 332	%	99.490	96.885	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P Series M	USD	1'000.00	25.05.2017	28.05.2019	35 912 903	%	98.460	96.881	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P Series M	USD	1'000.00	25.05.2017	28.05.2019	35 912 904	%	98.010	96.881	100.000		0.000	Y
Delta Autocallable Notes on Goldman Sachs (Cayman) Shs 30.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.148%	GBP	1'000.00	03.06.2015	29.05.2019	27 062 636		-	94.390	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Rio Tinto Sp ADR	USD	1'000.00	05.07.2017	05.07.2019	34 108 162	CHF	1179.590	96.867	100.000		0.000	Y
Partizipation Notes auf SMI-Index	USD	1'000.00	10.07.2015	10.07.2019	27 811 810	%	99.530	93.800	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Aktien 15.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.753%	USD	1'000.00	14.03.2017	16.09.2019	34 108 107		-	95.670	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	29.09.2017	30.09.2019	34 108 183	CHF	1005.450	96.681	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on FTSE 100	GBP	1'000.00	04.05.2017	04.11.2019	35 911 926	%	104.370	98.546	100.000		0.000	Y
Regd.Worst of Autocallable Certificates on a Basket of Indices	GBP	1'000.00	18.11.2013	18.11.2019	21 916 085	CHF	1687.360	89.159	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	GBP	1'000.00	12.12.2017	12.12.2019	38 848 834	%	96.710	98.358	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	USD	1'000.00	13.12.2017	13.12.2019	38 848 931	%	94.750	96.219	100.000		0.000	Y
Notes on Index-Basket 13.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.69%	GBP	1'000.00	13.01.2015	13.01.2020	25 391 973		-	93.627	100.000		0.000	Y
3.34 % Fixed Rate Zero Recovery Credit-Linked Notes Cr Lnk on Markit iTraxx Europe Crossover Ent	CHF	1'000.00	25.02.2015	14.01.2020	26 154 444	%	97.910	100.000	100.000	14.01. 14.07.	16.700 16.700	N
4.35 % Fixed Rate Zero Recovery Credit-Linked Notes Cr Lnk on Markit iTraxx Europe Crossover Index	EUR	1'000.00	25.02.2015	14.01.2020	26 154 443	%	99.040	100.000	100.000	14.01. 14.07.	23.319 24.034	N
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	08.02.2017	10.02.2020	34 736 206	%	101.400	94.951	100.000		0.000	Y
Capital Protected Notes on STOXX ELBH Div50-Index	USD	1'000.00	23.02.2015	24.02.2020	26 154 478	%	95.400	91.790	100.000		0.000	Y
Autocallable-Note auf Index-Basket	GBP	1'000.00	18.03.2015	18.03.2020	26 154 754	%	137.000	92.453	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 21.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.837%	USD	1'000.00	21.03.2017	23.03.2020	34 108 116		-	94.430	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P Series M	GBP	1'000.00	07.04.2017	06.04.2020	35 911 453	%	96.660	97.789	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Glencore Series M	USD	1'000.00	25.05.2017	26.05.2020	35 912 899	%	113.700	94.909	100.000		0.000	Y
Notes auf Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	05.06.2015	05.06.2020	27 811 787	%	96.410	91.953	100.000		0.000	Y
Participation Notes auf SMI-Index	USD	1'000.00	05.06.2015	05.06.2020	27 811 786	%	97.000	91.953	100.000		0.000	Y
Worst of Autocallable Certificates VRN on a Basket of Indices 12.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.923%	GBP	1'000.00	12.06.2015	13.06.2020	27 680 876		-	92.262	100.000		0.000	Y
Worst Of Autocallable Certificates on a Basket of Shs	USD	1'000.00	07.07.2015	07.07.2020	27 681 091	%	91.660	91.377	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	USD	1'000.00	12.07.2017	13.07.2020	37 044 728	CHF	1042.680	94.845	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes	USD	1'000.00	14.07.2017	14.07.2020	37 044 811	%	98.900	94.789	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	20.07.2017	20.07.2020	37 044 435	CHF	1020.270	94.943	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Porsche A Hldg Vz I	USD	1'000.00	24.07.2017	24.07.2020	37 044 838	%	115.340	94.828	100.000		0.000	Y
Participation Notes auf Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	31.07.2015	31.07.2020	28 322 003	%	94.910	91.511	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Renault	USD	1'000.00	01.08.2017	03.08.2020	37 173 934	%	100.480	91.161	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.08.2017	11.08.2020	37 044 898	CHF	1010.530	95.001	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	20.08.2015	20.08.2020	29 047 231	%	94.600	91.714	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Porsche A Hldg Vz I	GBP	1'000.00	21.08.2017	21.08.2020	37 174 373	%	112.470	97.990	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1.00	01.09.2017	01.09.2020	37 590 420	%	98.460	90.430	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 27.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.093%	USD	1'000.00	25.09.2015	25.09.2020	29 047 539		-	92.636	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	01.10.2015	01.10.2020	29 047 533	CHF	969.600	92.148	100.000		0.000	Y
Partizipation Notes auf Aktien-Basket	USD	99.00	06.10.2014	06.10.2020	25 012 445	%	93.650	87.878	100.000		0.000	Y
Participation-Notes auf Aktien-Basket	USD	1'000.00	10.10.2014	13.10.2020	25 012 519	%	93.350	87.950	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf ESTX50 EUR P 24.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.101%	USD	1'000.00	20.10.2015	20.10.2020	29 170 119		-	93.321	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indizes 24.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.101%	USD	1'000.00	20.10.2015	20.10.2020	29 170 118		-	93.321	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	27.10.2017	27.10.2020	38 695 223	%	97.500	94.619	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR	USD	1'000.00	29.11.2017	01.12.2020	38 433 246	%	97.160	94.254	100.000		0.000	Y
Capped Participation Notes auf Euro Stoxx 50-Index	EUR	1'000.00	14.12.2015	14.12.2020	30 261 716	%	97.190	89.208	90.000		0.000	Y
Zert. auf FTSE 100-Index 13.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.42%	USD	1'000.00	11.03.2016	11.03.2021	31 638 294		-	93.914	100.000		0.000	Y
ProtectionParticipation auf Euro Stoxx 50	USD	2'000.00	11.05.2016	11.05.2021	32 119 824	%	100.330	93.644	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	30.06.2017	30.06.2021	34 108 157	CHF	1148.810	99.920	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Aktien	EUR	1'000.00	07.07.2017	07.07.2021	34 108 160	CHF	1177.290	99.502	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Goldman Sachs (Cayman) Ltd 16.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 95.626%	GBP	1'000.00	06.10.2016	29.09.2021	33 134 582		-	97.600	100.000		0.000	Y
Protection Participation auf Aktien	USD	1'000.00	20.12.2017	20.12.2021	39 414 273	%	99.200	87.189	95.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P Series K	USD	1'000.00	16.06.2017	16.06.2022	36 779 739	%	92.940	91.484	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on	USD	1'000.00	12.07.2017	12.07.2022	37 044 528	%	114.070	91.161	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Imperial Brands	USD	1'000.00	20.07.2017	20.07.2022	37 044 766	%	98.880	90.462	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on AstraZeneca	USD	1'000.00	24.07.2017	25.07.2022	37 044 836	%	102.890	90.573	100.000		0.000	Y
reverse Convertible on JPMorgan Chase	USD	1'000.00	01.08.2017	01.08.2022	37 173 935	%	105.030	91.161	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf Indices	USD	1'000.00	18.08.2017	18.08.2023	37 590 217	%	99.800	89.227	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible auf ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	11.09.2017	11.09.2023	37 925 293	%	100.200	89.490	100.000		0.000	Y
Goldman Sachs Finance Corp International LTD, St Helier, Jersey												
Reverse Convertible on BANKIA Br	EUR	1'000.00	03.10.2017	03.10.2019	38 024 200	%	101.430	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	31.10.2017	31.10.2019	38 652 229	CHF	1064.340	96.468	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	31.10.2017	31.10.2019	38 652 236	%	98.810	96.487	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	03.11.2017	04.11.2019	38 652 239	CHF	1039.930	96.466	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	07.11.2017	07.11.2019	38 877 713	%	98.250	96.470	100.000		0.000	Y
Reverse % (pro rata)Convertible on Indices	USD	10'000.00	08.11.2017	08.11.2019	38 877 782	%	99.140	96.448	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	13.11.2017	13.11.2019	38 877 632	CHF	986.050	96.434	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Roche Hldg DR	CHF	1'000.00	24.11.2017	25.11.2019	38 877 646	CHF	723.450	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on on Indices	USD	1.00	30.11.2017	03.12.2019	38 831 538	%	98.500	96.268	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	05.07.2017	06.07.2020	37 044 534	%	96.260	95.102	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	10.07.2017	10.07.2020	37 044 666	%	96.520	95.102	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	21.07.2017	21.07.2020	37 044 700	%	96.180	95.015	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	25.08.2017	25.08.2020	37 590 383	%	97.660	95.095	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Banco Santander	EUR	1'000.00	11.09.2017	11.09.2020	37 938 773	%	99.080	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	25.09.2017	22.09.2020	37 975 656	%	99.660	95.413	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	25.09.2017	22.09.2020	37 975 655	%	100.270	95.413	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	02.10.2017	02.10.2020	38 024 117	%	96.190	94.833	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	10.10.2017	09.10.2020	38 497 955	%	96.250	94.627	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	26.10.2017	26.10.2020	38 651 940	%	98.420	94.507	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	01.11.2017	02.11.2020	38 498 043	%	97.100	94.349	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Zurich Insur Gr	CHF	302.35	13.11.2017	12.11.2020	36 786 671	CHF	293.180	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on HS China Ent	USD	1'000.00	22.11.2017	23.11.2020	38 433 300	CHF	977.490	94.254	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	13.12.2017	14.12.2020	38 433 317	%	98.190	94.036	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	20.12.2017	21.12.2020	39 315 973	CHF	959.700	93.931	100.000		0.000	Y
Protection Participation on MSCI World	USD	1'000.00	27.10.2017	27.04.2021	38 460 682	%	98.620	93.386	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on SMI	CHF	1'000.00	15.12.2017	15.06.2021	38 831 520	CHF	994.740	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on MSCI World	USD	1'000.00	29.09.2017	29.09.2021	37 590 617	%	98.000	92.817	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	GBP	1'000.00	10.10.2017	11.10.2021	38 497 991	%	96.900	95.028	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	16.10.2017	18.10.2021	38 653 396	%	95.850	99.601	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	USD	1'000.00	22.11.2017	22.11.2021	38 652 117	CHF	988.010	92.211	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	14.12.2017	14.12.2021	38 433 237	CHF	973.510	91.919	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.07.2017	14.07.2022	37 044 809	%	64.880	90.475	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Basket	USD	1'000.00	02.08.2017	02.08.2022	37 174 109	%	97.440	90.786	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	21.07.2017	04.08.2022	37 044 557	%	100.300	98.759	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.10.2017	26.10.2022	38 651 948	%	99.180	90.387	100.000		0.000	Y
Protection Participation on STX GlInfr30 PR EUR	EUR	1'000.00	26.10.2017	26.10.2022	38 651 926	%	96.780	89.048	90.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.11.2017	02.11.2022	38 857 794	CHF	951.140	89.985	100.000		0.000	Y
Reverse Conevrtible on Euro Stoxx 50	EUR	1'000.00	31.10.2017	07.11.2022	38 551 212	%	95.380	99.030	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on	USD	1'000.00	12.12.2017	12.12.2022	39 316 126	%	96.810	80.723	90.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	20.10.2017	24.10.2023	38 551 312	%	98.150	98.032	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	28.11.2017	28.11.2023	38 831 024	%	98.370	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	GBP	1'000.00	08.12.2017	08.12.2023	39 315 979	%	99.530	93.237	100.000		0.000	Y
Goldman Sachs Group, Inc., New York, USA												
(3.15 % min.) Capped and Floored Floating Notes Floating Rate Series F Senior	EUR	1'000.00	01.03.2012	01.03.2017	4 291 671		-	100.000	100.000	01.03.	8.386	N
(2 % min./4 % max.) Regd.Capped and Floored Floater Notes Floating Rate Series F Senior	CHF	1'000.00	29.03.2012	29.03.2017	4 301 960		-	100.000	100.000	29.03.	5.000	N
(1.9 % min.) Regd.Capped & Floored Floater Notes Floating Rate Series F Senior	CHF	1'000.00	28.06.2012	28.06.2017	18 015 431		-	100.000	100.000	28.03. 28.06.	4.750 4.855	N
(3 1/4 % min.) Regd.Floored Floater Notes Floating Rate Series F Senior	GBP	1'000.00	20.07.2012	20.07.2017	18 015 434		-	100.000	100.000	20.01. 20.04. 20.07.	10.146 10.239 10.009	N
(1.9 % min.) Regd.Floored Floater Notes Floating Rate Series F Senior	CHF	1'000.00	26.06.2012	26.07.2017	18 015 435		-	100.000	100.000	26.01. 26.04. 26.07.	4.855 4.750 4.802	N
(1 1/2 % min.) Regd.Floored Floater Notes Floating Rate Series F Senior	CHF	1'000.00	30.08.2012	30.08.2017	18 644 296		-	100.000	100.000	28.02. 30.05. 30.08.	3.750 3.791 3.833	N
(2.05 % min.) Regd.Capped and Floored Floater Notes Floating Rate Series F Senior	EUR	1'000.00	27.09.2012	27.09.2017	4 291 674		-	100.000	100.000	27.03. 27.06. 27.09.	5.424 5.705 5.990	N
Regd.Capped and Floored Floater Notes Floating Rate Series F Senior	EUR	1'000.00	12.03.2014	12.03.2019	20 945 085	%	100.450	100.000	100.000	13.03. 12.06. 12.09. 12.12.	2.172 2.195 2.345 2.354	N
Regd.Participation Notes on STOXX Europe Low Beta Ix	USD	1'000.00	10.12.2014	10.12.2019	24 523 433	%	99.910	87.476	95.000		0.000	Y
3/4 % (9 % P.A.) Capital Protected Callable Notes on STX HDLB 50 EUR P Senior	USD	1'000.00	26.06.2015	26.06.2020	25 486 065	%	96.740	91.831	100.000	26.06.	7.250	Y
Capital Protected Callable Notes on Euro Stoxx 50 Index Series H	USD	1'000.00	27.07.2015	27.07.2020	27 058 673	%	96.180	91.390	100.000		0.000	Y
Capital Protected Callable Notes on STX HDLB 50 EUR P Ix Series H	USD	1'000.00	27.07.2015	27.07.2022	27 058 677	%	92.200	86.159	100.000		0.000	Y
Goldman Sachs International, London, Grossbritannien												
Bonus Certificates on Russell 1000 Growth Index	USD	1'000.00	31.05.2013	09.01.2017	20 860 662		-	97.460	100.000		0.000	Y
3 5/8 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.04.2016	25.01.2017	31 864 793		-	100.000	100.000	25.01.	0.000	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
3 5/8 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	25.04.2016	25.01.2017	32 322 975		-	100.000	100.000	25.01.	29.178	N
8.4 % Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	27.01.2016	27.01.2017	29 386 802		-	100.000	100.000	27.01.	0.000	Y
WorstOf Bonus (Perles Plus) Certificates on a Basket of Indices	USD	1'000.00	31.01.2014	31.01.2017	22 861 137		-	97.507	100.000		0.000	Y
Bonus Certificates on S&P 500 Buyback Index	USD	1'000.00	31.01.2014	31.01.2017	22 397 772		-	97.507	100.000		0.000	Y
Bonus Certificates on MSCI AC Asia Ex Japan Index	USD	1'000.00	13.02.2013	13.02.2017	20 249 741		-	97.026	100.000		0.000	Y
Bonus Certificates on FTSE 100 Index	GBP	1'000.00	15.05.2013	14.02.2017	20 860 552		-	97.095	100.000		0.000	Y
5.15 % Reverse Convertible on Equities	CHF	100.00	15.02.2016	15.02.2017	30 967 494		-	100.000	100.000	15.02.	0.000	Y
Underlying Tracker on FTSE MIB	EUR	1'000.00	19.02.2015	20.02.2017	26 154 512		-	99.727	100.000		0.000	Y
Market Timer Certificates on S&P 500 Index	USD	1'000.00	20.08.2013	21.02.2017	21 447 964		-	96.449	100.000		0.000	Y
Participation Notes on Euro Stoxx 50-Index	EUR	1'000.00	21.02.2014	21.02.2017	22 861 532		-	93.333	95.000		0.000	Y
Bonus Certificates on S&P 500 Buyback Index	USD	1'000.00	21.02.2014	21.02.2017	22 861 612		-	97.705	100.000		0.000	Y
Bonus Certificates on S&P 500 Buyback Index	USD	1'000.00	25.02.2014	27.02.2017	22 861 385		-	97.638	100.000		0.000	Y
Capital Protected Notes on basket	USD	1'000.00	04.03.2014	06.03.2017	23 266 837		-	92.714	95.000		0.000	Y
Bonus (Perles Plus) Certificates on Swiss Market SMI Index	CHF	1'000.00	05.09.2014	08.03.2017	24 420 959		-	99.857	100.000		0.000	Y
Outperformance Certificates on S&P 500 Buyback Index	USD	113.44	10.03.2014	10.03.2017	23 266 891		-	97.635	100.000		0.000	Y
Memory Phoenix Autocallable Certificates VRN on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	17.09.2015	17.03.2017	29 047 496		-	99.969	100.000		0.000	Y
Phoenix Autocallable Certificates VRN on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	17.09.2015	17.03.2017	29 047 495		-	99.969	100.000		0.000	Y
Worst Of Bonus Certificates on a Basket of Indices	USD	1'000.00	20.09.2013	20.03.2017	21 448 109		-	95.806	100.000		0.000	Y
Bonus Certificates on S&P 500 Buyback Index	USD	1'000.00	27.03.2014	27.03.2017	23 266 779		-	97.036	100.000		0.000	Y
Participation-Notes on Index-Basket	EUR	1'000.00	25.03.2015	27.03.2017	26 154 653		-	94.801	95.000		0.000	Y
Participation Notes on Index-Basket	USD	1'000.00	25.03.2015	27.03.2017	26 154 652		-	93.241	95.000		0.000	Y
Bonus (Perles Plus) Certificates on Pfizer Inc Shs	USD	0.000	28.03.2014	28.03.2017	23 267 069		-	97.010	100.000		0.000	Y
Bonus (Perles Plus) Certificates on Apple Inc Shs	USD	532.87	28.03.2014	28.03.2017	23 267 070		-	97.010	100.000		0.000	Y
5.4 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	31.03.2016	30.03.2017	31 498 983		-	100.000	100.000	03.01.	0.000	N
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	07.04.2015	07.04.2017	27 062 271		-	98.378	100.000		0.000	Y
4.9375 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	12.10.2016	11.04.2017	33 784 819		-	100.000	100.000	11.01. 11.04.	50.401 48.998	N
Market Timer Certificates on S&P 500 Index	USD	1'000.00	23.10.2013	25.04.2017	21 915 802		-	96.584	100.000		0.000	Y
(3 1/4 % min./6 % max.) Regd.Capped and Floored Certificates Floating Rate	USD	1'000.00	27.04.2012	27.04.2017	10 473 779		-	100.000	100.000	27.01. 27.04.	8.290 8.081	N
Protection Participation on Equities	EUR	1'000.00	02.06.2016	19.05.2017	31 864 862		-	95.000	95.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	03.06.2016	19.05.2017	32 023 001		-	93.863	95.000		0.000	Y
WorstOf Bonus Certificates on a Basket of Indices	EUR	1'000.00	23.05.2014	23.05.2017	23 702 158		-	98.593	100.000		0.000	Y
Regd.Capped & Floored Floater Certificates Floating Rate	EUR	1'000.00	24.05.2012	24.05.2017	10 473 915		-	100.000	100.000	24.02. 24.05.	8.068 8.101	N
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	100.00	26.05.2015	26.05.2017	27 062 821		-	98.286	100.000		0.000	Y
6 3/4 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.05.2016	26.05.2017	32 233 237		-	100.000	100.000	26.05.	8.000	Y
Bonus (Perles Plus) Certificates 2014-28.12.16on Hang Seng China Enterprises Ix	EUR	1'000.00	29.11.2013	29.05.2017	21 916 137		-	97.511	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	29.05.2015	31.05.2017	27 062 908		-	98.402	100.000		0.000	Y
3.45 % Reverse Convertible on JP Morgan Chase	CAD	1'000.00	01.06.2016	01.06.2017	32 233 305		-	100.000	100.000	01.06.	6.930	Y
4.35 % Reverse Convertible on Bank of America	CAD	1'000.00	01.06.2016	01.06.2017	32 233 299		-	100.000	100.000	01.06.	6.930	Y
Quanto USD Bonus (Perles Plus) Certificates on UBS Group Inc Shs	USD	1'000.00	04.06.2015	07.06.2017	27 063 052		-	98.273	100.000		0.000	Y
Regd.Market Timer Certificates on S&P 500 Index	USD	1'000.00	13.06.2013	14.06.2017	21 038 582		-	96.402	100.000		0.000	Y
Autocallable Certificates on a Basket of Indices	USD	1'000.00	15.06.2015	16.06.2017	27 063 078		-	98.287	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Bonus (Perles Plus) Certificates on Euro Stoxx 50 Index	EUR	3'077.08	18.02.2014	19.06.2017	23 266 655		-	97.769	100.000		0.000	Y
Capped Bonus Certificates on a Basket of Indices & Fund	USD	1'000.00	03.07.2014	03.07.2017	23 824 760		-	97.033	100.000		0.000	Y
Bonus Certificates on S&P 500 Inf Tec Index	USD	1'000.00	05.07.2013	05.07.2017	21 038 555		-	95.281	100.000		0.000	Y
Twin Win (Perles Plus) Certificates on S&P 500 Index	USD	1'000.00	31.01.2014	10.07.2017	22 861 149		-	96.456	100.000		0.000	Y
WorstOf Bonus (Perles Plus) Certificates on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	10.07.2015	10.07.2017	27 681 256		-	100.000	100.000		0.000	Y
Market Timer Certificates on IBEX 35 Index	USD	1'000.00	09.07.2014	11.07.2017	23 824 733		-	96.846	100.000		0.000	Y
5.4 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	USD	1'000.00	12.07.2016	12.07.2017	32 647 879		-	100.000	100.000	12.07.	11.850	Y
Participation-Notes on Basket	AUD	1'000.00	15.07.2014	17.07.2017	23 824 788		-	89.880	98.000		0.000	Y
Market Timer Certificates on S&P 500 Index	USD	1'000.00	24.01.2014	24.07.2017	22 861 210		-	95.944	100.000		0.000	Y
WorstOf Bonus (Perles Plus) Certificates on a Basket of Indices	USD	1'000.00	24.07.2014	24.07.2017	23 824 806		-	96.745	100.000		0.000	Y
Twin Win Certificates on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	26.11.2013	26.07.2017	22 397 321		-	97.123	100.000		0.000	Y
Certificates on S&P 500 Index	USD	1'000.00	30.01.2014	31.07.2017	22 861 315		-	96.187	100.000		0.000	Y
WorstOf Bonus (Perles Plus) Certificates on a Basket of Indices	USD	1'000.00	31.01.2014	31.07.2017	22 861 226		-	96.389	100.000		0.000	Y
Regd.WorstOf Bonus (Perles Plus) Certificates on a Basket of Shs	USD	1'000.00	29.07.2014	31.07.2017	23 824 991		-	96.693	100.000		0.000	Y
Regd.Worst of Bonus (Perles Plus) Certificates on a Basket of Indices	USD	1'000.00	03.02.2014	04.08.2017	22 861 450		-	96.327	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	04.02.2015	04.08.2017	25 392 033		-	99.998	100.000		0.000	Y
Market Timer Certificates on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	10.02.2014	11.08.2017	22 861 448		-	96.327	100.000		0.000	Y
WorstOf Bonus Certificates on a Basket of Indices	USD	1'000.00	14.02.2014	14.08.2017	22 861 609		-	96.642	100.000		0.000	Y
Bonus Certificates on a Basket of Indices	EUR	1'000.00	16.12.2013	16.08.2017	22 397 564		-	97.186	100.000		0.000	Y
Bonus Certificates on a Basket of Indices	USD	1'000.00	16.12.2013	16.08.2017	22 397 607		-	96.461	100.000		0.000	Y
Market Timer Certificates on S&P 500 Index	USD	1'000.00	21.02.2014	21.08.2017	22 861 569		-	96.473	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	24.02.2016	22.08.2017	31 498 508		-	100.000	100.000		0.000	Y
Timer Certificates on S&P 500 Index	USD	1'000.00	27.02.2014	28.08.2017	23 266 654		-	96.402	100.000		0.000	Y
Participation Note on SMI-Index	MXN	10'000.00	28.08.2015	28.08.2017	29 047 348		-	87.115	95.000		0.000	Y
8.2 % Reverse Convertible on LafargeHolcim N	CHF	250'000.00	29.08.2016	29.08.2017	33 134 355		-	100.000	100.000	29.08.	0.000	Y
Participation-Notes on basket of indices	USD	1'000.00	12.09.2014	12.09.2017	24 421 158		-	86.939	90.000		0.000	Y
Twin Win Certificatess on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	25.09.2014	25.09.2017	25 012 419		-	99.175	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Glencore	GBP	1'000.00	29.09.2015	29.09.2017	29 169 970		-	98.040	100.000		0.000	Y
Regd.Market Timer Certificates on S&P 500 Index	USD	1'000.00	09.04.2014	11.10.2017	23 267 129		-	95.843	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	21.10.2015	23.10.2017	29 170 133		-	99.907	100.000		0.000	Y
Worst of Bonus Certificates on a Basket of Indices	EUR	1'000.00	25.10.2013	25.10.2017	21 915 760		-	96.076	100.000		0.000	Y
Leveraged Bonus Certificates on Euro Stoxx 50 Index	EUR	0.000	25.10.2013	25.10.2017	21 915 763		-	96.076	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	26.04.2016	26.10.2017	31 547 227		-	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	29.04.2016	30.10.2017	31 864 655		-	93.754	95.000		0.000	Y
Bonus Certificates on S&P 500 Index	USD	1'000.00	04.11.2015	06.11.2017	29 819 027		-	98.509	100.000		0.000	Y
5.15 % Reverse Convertible on AbbVie	USD	1'000.00	07.11.2016	07.11.2017	34 127 336		-	100.000	100.000	07.11.	9.900	Y
Regd.WorstOf Bonus Certificates on a Basket of Indices	EUR	1'000.00	08.11.2013	08.11.2017	21 915 943		-	96.661	100.000		0.000	Y
Participation Note on Stoxx Europe 600 Index	MXN	10'000.00	13.11.2015	13.11.2017	29 386 186		-	87.410	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	17.11.2014	14.11.2017	25 322 770		-	96.622	100.000		0.000	Y
CHF Lock In Call Warrant on the SLI Swiss Leader Index	CHF	543.80	22.11.2007	21.11.2017	3 574 591		-	73.210	100.000		0.000	Y
Capped Outperformance Certificates on S&P GSCI Agri Excess Return E28Strategy Idx	USD	1'000.00	17.12.2007	18.12.2017	3 612 656		-	62.080	100.000		0.000	Y
3.7 % Reverse Convertible on S&P GSCI Excess Ret Ser K	EUR	1'000.00	12.01.2017	29.12.2017	34 527 685		-	100.000	100.000	29.12.	0.000	Y
Market Timer Certificates 2013-5.1.18 on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	07.01.2014	05.01.2018	22 397 738	CHF	1172.290	95.479	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
10 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	19.01.2017	19.01.2018	34 735 824	%	99.300	100.000	100.000	19.04. 19.07. 19.10.	4.236 4.050 4.136	N
3.8 % Reverse Convertible 2017-22.01.18 on Equities	USD	1'000.00	20.01.2017	20.01.2018	34 735 826	%	135.600	100.000	100.000	20.04. 20.07. 20.10.	3.629 3.470 3.587	N
Worst-of Bonus Certificates on Basket of Shs	CHF	1'000.00	22.01.2016	22.01.2018	29 386 735	CHF	931.500	100.000	100.000		0.000	Y
6.6 % Reverse Convertible on China Molybdenu -H- Series M	HKD	1'000.00	25.01.2017	25.01.2018	34 735 930	%	99.170	100.000	100.000	25.07.	0.9431	N
4.26 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	27.01.2017	29.01.2018	34 735 996	%	103.200	100.000	100.000		0.000	Y
Bonus Certificates Variable rate on S&P 500 Index	USD	1'502.96	31.01.2013	31.01.2018	19 724 839	CHF	2603.790	95.318	100.000		0.000	Y
Bonus Certificates VRN on Euro Stoxx 50 Index	EUR	2'744.18	31.01.2013	31.01.2018	19 724 838	CHF	4082.650	94.988	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Daxk	EUR	1'000.00	11.02.2015	12.02.2018	26 154 446	CHF	1264.930	99.478	100.000		0.000	Y
6 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.02.2017	12.02.2018	34 736 241	%	104.600	98.315	100.000		0.000	Y
Bonus (Perles Plus) Certificates on Glencore Intl Plc Shs	GBP	2.69	13.02.2015	13.02.2018	26 154 465	CHF	5.140	96.782	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 14.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.308%	USD	1'000.00	14.11.2016	14.02.2018	34 127 332		-	98.755	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Daxk	EUR	1'000.00	27.02.2015	27.02.2018	26 154 392	CHF	1252.060	99.461	100.000		0.000	Y
5.7 % Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	28.02.2017	28.02.2018	35 342 047	%	104.500	100.000	100.000		0.000	Y
5.05 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	28.02.2017	28.02.2018	35 342 048	%	103.900	100.000	100.000		0.000	Y
Ceritificates on a Basket of Indices	USD	1'000.00	28.02.2013	01.03.2018	20 457 495	CHF	2301.700	95.148	100.000		0.000	Y
Booster on a Basket of Shs	USD	96.25	03.03.2015	05.03.2018	26 154 569	CHF	87.840	96.366	100.000		0.000	Y
Participation Notes on UBS (Lux) Global High Div Fund	AUD	150'000.00	03.03.2015	05.03.2018	26 154 566	%	105.850	91.389	97.500		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	USD	100.00	03.03.2015	05.03.2018	26 154 570	CHF	87.890	96.366	100.000		0.000	Y
Booster on Basket of Shs	EUR	96.85	03.03.2015	05.03.2018	26 154 568	CHF	99.460	99.514	100.000		0.000	Y
Worst Of Range Accrual Certificates on a Basket of Indices	USD	1'000.00	17.03.2015	19.03.2018	26 154 660	%	102.000	96.229	100.000		0.000	Y
4 % Reverse Convertible on Lindt&Spruengli PS	CHF	10'000.00	23.03.2017	23.03.2018	35 342 670	%	102.190	100.000	100.000		0.000	Y
Participation Notes on Index-Basket	USD	1'000.00	25.03.2015	26.03.2018	26 154 654	%	93.400	91.445	95.000		0.000	Y
Memory Phoenix Worst Of Autocallable Certificates on a Basket of Indices	USD	1'000.00	25.03.2015	26.03.2018	26 154 751	%	100.400	96.159	100.000		0.000	Y
4.15 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	04.04.2017	04.04.2018	35 911 495	%	100.000	100.000	100.000		0.000	Y
8.1 % Reverse Convertible on Royal Dutch Shell-A	EUR	1'000.00	04.04.2017	06.04.2018	35 911 504	%	107.100	100.000	100.000		0.000	Y
Market Timer Certificates on S&P 500 Index	USD	1'000.00	25.04.2013	25.04.2018	20 860 539	%	172.100	95.621	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	27.04.2015	27.04.2018	27 062 282	CHF	1091.000	100.000	100.000		0.000	Y
2.6 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities 27.4.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	27.10.2016	27.04.2018	33 982 238		-	100.000	100.000	27.01. 27.04.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Indices 2.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.904%	USD	1'000.00	02.11.2016	04.05.2018	33 982 199		-	98.520	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S & P 400	USD	1'000.00	06.05.2015	07.05.2018	27 062 443	CHF	1207.370	96.679	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	11.05.2015	09.05.2018	27 062 602	%	102.200	99.683	100.000		0.000	Y
Worst of Autocallable Certificates VRN on a Basket of Indices	EUR	1'000.00	11.05.2015	09.05.2018	27 062 603	%	101.700	99.683	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 9.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.166%	USD	1'000.00	08.11.2016	09.05.2018	34 127 348		-	98.450	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	09.05.2017	09.05.2018	35 912 168	%	102.900	96.286	100.000		0.000	Y
Outperformance Certificates on S&P Global 1200 Dividend Idx	EUR	1'000.00	11.05.2015	11.05.2018	27 062 314	%	118.300	99.521	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	12.05.2015	15.05.2018	27 062 705	CHF	769.340	96.420	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	19.05.2015	18.05.2018	27 062 542	CHF	1108.000	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on EiSTX HDLV 50 EUR P	USD	1'000.00	24.05.2016	25.05.2018	32 023 079	CHF	1080.690	98.181	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on EiSTX HDLV 50 EUR P	EUR	1'000.00	24.05.2016	25.05.2018	32 023 080	CHF	1317.580	99.990	100.000		0.000	Y
6.6 % Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	02.06.2017	01.06.2018	35 913 110	%	102.240	100.000	100.000		0.000	Y
Bonus Certificates on Nikkei 225 Index	JPY	100'000.00	31.05.2013	04.06.2018	21 019 787	CHF	1376.820	93.117	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	04.06.2015	05.06.2018	27 063 051	CHF	1098.230	96.481	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
8.2 % Reverse Convertible (exp.21.05.18) on Equities	USD	1'000.00	05.06.2017	05.06.2018	35 913 109	%	102.730	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 9.3.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.483%	USD	1'000.00	07.12.2016	06.06.2018	34 336 495		-	98.220	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 9.3.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	07.12.2016	06.06.2018	34 336 496		-	98.200	100.000		0.000	Y
Early Redemption Bonus (Perles Plus) Certificates on Euro Stoxx Banks Index	USD	1'000.00	16.06.2014	13.06.2018	23 702 439	CHF	754.730	94.703	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on S&P 500 Energy Index	USD	1'000.00	15.06.2015	15.06.2018	27 063 082	%	98.100	96.513	100.000		0.000	Y
Redemption Bonus Certificates on Euro Stoxx Banks Index	USD	1'000.00	18.06.2014	18.06.2018	23 702 469	CHF	761.060	94.504	100.000		0.000	Y
Memory Phoenix Autocallable Certificates VRN on Euro Stoxx 50 Index 16.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.196%	USD	1'000.00	16.06.2015	18.06.2018	27 680 899		-	96.060	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	16.12.2016	18.06.2018	34 127 457	CHF	1486.070	98.160	100.000		0.000	Y
Autocallable Certificates on a Bskt of Ix and Exchange Rate	USD	1'000.00	26.06.2015	26.06.2018	27 680 953	%	98.500	96.101	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Daxk	USD	959.00	27.06.2016	27.06.2018	32 233 552	CHF	1093.360	98.270	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	956.00	27.06.2016	27.06.2018	32 233 553	CHF	1304.710	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Daxk	EUR	959.00	27.06.2016	27.06.2018	32 233 551	CHF	1326.950	99.990	100.000		0.000	Y
Market Timer Certificates on S&P 500 Index	USD	1'000.00	01.07.2014	02.07.2018	23 824 674	CHF	1339.900	94.396	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	30.06.2015	02.07.2018	27 063 062	CHF	1207.590	99.256	100.000		0.000	Y
Participation Notes on Euro Stoxx 50-Index	MXN	10'000.00	30.06.2015	02.07.2018	27 681 092	%	96.850	87.208	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Indices	EUR	1'000.00	30.06.2016	02.07.2018	32 233 616	%	111.420	90.000	90.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	07.07.2017	09.07.2018	37 044 589	%	105.000	96.324	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on iSh MSCI EAFE	USD	1'000.00	07.04.2017	10.07.2018	35 911 598	CHF	1080.690	98.223	100.000		0.000	Y
Early Redemption Bonus (Perles Plus) Certificate on EURO STOXX Banks Index	USD	1'000.00	16.07.2014	16.07.2018	23 824 642	CHF	833.660	94.210	100.000		0.000	Y
Twin Win Certificates on S&P 500 Index	USD	1'000.00	31.07.2014	31.07.2018	23 824 836	CHF	1295.070	94.106	100.000		0.000	Y
Twin Win Certificates on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	04.08.2014	02.08.2018	23 824 829	CHF	1282.480	97.952	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Daxk	USD	1'000.00	02.02.2015	03.08.2018	26 154 346	%	106.000	91.039	95.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	02.02.2015	03.08.2018	26 154 348	%	99.600	91.039	95.000		0.000	Y
Underlying Tracker on EiSTX HDLV 50 EUR P	EUR	1'000.00	03.08.2016	03.08.2018	32 648 108	CHF	1303.540	100.000	100.000		0.000	Y
Capital Protected Notes on S&P 500-Index	CHF	1'000.00	09.08.2013	09.08.2018	21 447 898	%	149.900	91.573	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 10.2.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	10.08.2016	10.08.2018	32 648 218		-	100.000	100.000		0.000	Y
Callable Participation Notes on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	18.02.2015	17.08.2018	26 154 358	%	100.100	90.571	95.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	USD	1'000.00	19.02.2015	20.08.2018	26 154 275	CHF	902.850	95.298	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	27.02.2015	27.08.2018	26 154 386	CHF	1218.120	99.267	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	18.03.2015	27.08.2018	26 154 562	%	110.700	90.737	95.000		0.000	Y
Twin Win Certificates on S&P 500 Index	USD	1'000.00	29.08.2014	31.08.2018	24 420 779	CHF	1280.460	94.050	100.000		0.000	Y
Twin Win Certificates on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	29.08.2014	31.08.2018	24 420 780	CHF	1287.160	98.424	100.000		0.000	Y
Callable Participation Notes on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	04.03.2015	31.08.2018	26 154 491	%	97.900	90.821	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 7.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	07.03.2017	04.09.2018	35 342 069		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.156%	USD	1'000.00	07.03.2017	05.09.2018	35 342 068		-	97.868	100.000		0.000	Y
6.1 % Reverse Convertible on Rio Tinto Rg	CHF	1'000.00	07.09.2017	07.09.2018	37 590 666	%	100.300	100.000	100.000		0.000	Y
Participation Notes on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	19.03.2015	19.09.2018	26 154 618	%	95.300	90.427	95.000		0.000	Y
Participation Notes on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	23.03.2015	24.09.2018	27 062 135	%	97.550	95.234	100.000		0.000	Y
Participation Notes on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	27.03.2015	27.09.2018	26 154 725	%	97.350	95.632	100.000		0.000	Y
Early Redemption Bonus (Perles Plus) Certificates on Daxk	EUR	1'000.00	02.04.2015	03.10.2018	26 154 705	CHF	1186.530	99.444	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	07.04.2015	04.10.2018	26 154 772	%	94.700	90.910	95.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Protection Participation on Indices	USD	1'000.00	05.10.2015	05.10.2018	29 169 960	%	99.200	96.770	100.000		0.000	Y
(1.2 % min./4 % max.) Regd.Floater Notes Floating Rate	EUR	1'000.00	07.10.2013	09.10.2018	21 448 213	%	100.300	100.000	100.000	07.01. 07.04. 07.07. 07.10.	3.290 3.206 3.332 3.526	N
Participation-Notes on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	09.04.2015	09.10.2018	27 062 285	%	94.500	90.990	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 10.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.599%	USD	1'000.00	07.04.2017	09.10.2018	35 911 448		-	97.784	100.000		0.000	Y
Market Timer Certificates on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	15.10.2015	16.10.2018	29 170 022	CHF	1158.650	97.076	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	20.04.2015	19.10.2018	27 062 194	%	96.750	95.783	100.000		0.000	Y
1.575 % (6.3 % p.a.) Reverse Convertible on AXA 19.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	21.04.2017	19.10.2018	35 911 807		-	100.000	100.000	19.07. 19.10.	16.886 18.340	N
Reverse Convertible on Indices 23.1.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 98.824%	GBP	1'000.00	21.10.2015	22.10.2018	29 170 127		-	96.751	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	20.04.2017	22.10.2018	35 911 574	CHF	1053.400	97.860	100.000		0.000	Y
Market Timer Certificates on S&P 500 Index	USD	1'000.00	23.04.2015	23.10.2018	27 062 381	CHF	1310.660	95.816	100.000		0.000	Y
Participation Notes on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	24.04.2015	24.10.2018	27 062 272	%	94.850	95.931	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	EUR	1'000.00	27.04.2017	25.10.2018	35 911 779	%	103.200	100.000	100.000		0.000	Y
Outperformance (Leveraged Perles) Certificates on Euro Stoxx 50 Index	EUR	2'927.30	27.10.2014	29.10.2018	25 012 715	CHF	4638.470	98.605	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	06.05.2015	05.11.2018	27 062 417	%	98.350	95.710	100.000		0.000	Y
Participation Notes on Shares-Basket	USD	1'000.00	08.05.2015	06.11.2018	27 062 700	%	93.250	90.742	95.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.05.2017	12.11.2018	35 912 247	%	101.100	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	14.08.2017	14.11.2018	37 174 355	CHF	1000.780	98.149	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	17.05.2017	19.11.2018	35 912 334	%	94.950	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 17.8.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	17.05.2017	19.11.2018	35 912 195		-	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	22.05.2015	23.11.2018	27 062 680	%	98.800	95.662	100.000		0.000	Y
3 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	23.11.2015	23.11.2018	29 170 136	%	99.200	100.000	100.000	23.11.	0.000	N
Reverse Convertible on on Nokian Tyres	EUR	1'000.00	23.11.2016	23.11.2018	34 127 443	%	106.300	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.05.2017	27.11.2018	35 912 900	%	102.900	97.799	100.000		0.000	Y
4.75 % Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	28.11.2017	28.11.2018	38 831 021	%	99.550	100.000	100.000		0.000	Y
Participation Notes on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	09.06.2015	10.12.2018	27 062 924	%	99.000	95.320	100.000		0.000	Y
Regd.Capped Outperformance Certificates on Intl Bus Machines Corp Shs	USD	1'000.00	12.12.2013	11.12.2018	22 397 550	%	81.260	93.004	100.000		0.000	Y
Regd.Capped Outperformance Certificates on Intl Bus Machines Corp Shs	USD	1'000.00	12.12.2013	11.12.2018	22 397 551	%	82.300	93.004	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.06.2017	13.12.2018	36 779 797	%	100.200	97.886	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker 2014-17.12.18 on S&P 500	USD	1'000.00	05.01.2015	17.12.2018	25 323 081	CHF	1263.890	94.387	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker 2014-17.12.18 on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	05.01.2015	17.12.2018	25 323 082	CHF	1067.050	94.387	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Gemalto	EUR	1'000.00	15.06.2017	17.12.2018	35 913 367	%	103.440	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on EDF Series M 15.12.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	15.06.2017	17.12.2018	35 913 366		-	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	19.06.2015	19.12.2018	27 680 951	%	99.300	95.008	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	19.06.2015	19.12.2018	27 063 105	%	99.300	95.008	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	20.12.2017	20.12.2018	39 316 225	%	102.900	98.051	100.000		0.000	Y
Capital Protected Notes on STOXX Europe Low Beta Ix	USD	1'000.00	30.12.2014	28.12.2018	25 322 996	%	104.100	91.578	100.000		0.000	Y
1.8275 % (pro rata) Reverse Convertible on BHP Billiton	EUR	1'000.00	12.07.2017	14.01.2019	37 044 722	%	100.900	100.000	100.000		0.000	N
5.35 % Reverse Convertible on Equities	CHF	1'000.00	19.01.2017	21.01.2019	34 735 828	%	101.300	100.000	100.000	19.07.	0.000	N

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
4.5 % Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	25.01.2017	25.01.2019	34 735 814	%	99.400	100.000	100.000	27.04. 25.07. 25.10.	14.430 13.927 14.759	N
Underlying Tracker on UBS Group N	CHF	1'000.00	27.01.2016	28.01.2019	29 386 804	CHF	1346.000	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Indices	USD	1'000.00	22.07.2015	29.01.2019	28 230 721	%	97.800	95.198	100.000		0.000	N
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	28.07.2015	29.01.2019	27 681 341	%	97.300	94.318	99.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	28.07.2017	29.01.2019	37 174 023	%	96.550	97.755	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.01.2017	30.01.2019	34 735 874		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 2.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	30.01.2017	30.01.2019	34 735 850		-	97.062	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	30.01.2017	30.01.2019	34 735 873		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 31.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.926%	USD	1'000.00	30.01.2017	31.01.2019	34 735 872		-	97.058	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities Series K	USD	1'000.00	01.02.2017	01.02.2019	34 736 074	%	98.920	97.028	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 5.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.272%	USD	1'000.00	03.02.2017	04.02.2019	34 735 999		-	97.009	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Axa	EUR	1'000.00	11.08.2016	11.02.2019	32 648 231	%	135.100	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Equities	USD	1'000.00	15.08.2017	15.02.2019	37 174 393	%	97.450	97.724	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities Series K	USD	1'000.00	16.02.2017	19.02.2019	34 736 145	%	97.240	97.058	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on MSCI AC World	USD	1'000.00	21.02.2017	19.02.2019	34 736 025	CHF	1096.280	97.039	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 22.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.349%	USD	1'000.00	21.02.2017	21.02.2019	34 736 263		-	97.097	100.000		0.000	Y
Market Timer Certificates on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	21.08.2015	22.02.2019	29 047 243	CHF	1059.250	95.199	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	24.02.2016	25.02.2019	31 498 542	CHF	1096.280	97.238	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	23.02.2017	25.02.2019	34 736 264	CHF	1012.470	96.902	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	23.02.2016	26.02.2019	31 498 526	CHF	1117.720	97.399	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Gilead Sciences	USD	1'000.00	24.02.2016	26.02.2019	31 498 546	CHF	941.340	97.236	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 23.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.347%	USD	1'000.00	24.02.2017	27.02.2019	35 341 799		-	97.106	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 24.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.341%	USD	1'000.00	27.02.2017	27.02.2019	35 341 835		-	97.106	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	03.03.2016	04.03.2019	31 498 666	CHF	1122.590	97.461	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on BBVA Rg 31.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	02.03.2017	04.03.2019	35 342 154		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 12.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.916%	USD	1'000.00	13.03.2017	13.03.2019	35 342 241		-	97.037	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	13.03.2017	13.03.2019	35 342 423	CHF	1068.020	94.951	100.000		0.000	Y
Bonus Certificates on S&P 500 Index	USD	1'873.00	14.03.2014	14.03.2019	23 266 937	CHF	2593.070	91.790	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 18.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.772%	USD	1'000.00	15.03.2017	15.03.2019	35 342 299		-	96.810	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	18.03.2016	18.03.2019	31 498 881	%	103.400	95.000	95.000		0.000	Y
Underlying Tracker on AB InBev Rg	USD	1'000.00	17.03.2017	18.03.2019	35 342 534	CHF	946.210	96.696	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 21.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	21.03.2017	21.03.2019	35 342 437		-	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	21.03.2017	21.03.2019	35 342 612	%	100.700	96.677	100.000		0.000	Y
Market Timer Certificates on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	31.03.2015	01.04.2019	27 062 148	CHF	1288.330	99.142	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Renault SA	EUR	1'000.00	03.04.2017	03.04.2019	35 342 711	%	104.840	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 6.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.465%	USD	1'000.00	04.04.2017	05.04.2019	35 342 733		-	96.777	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	AUD	1'000.00	06.04.2017	05.04.2019	35 911 570	%	99.400	95.878	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	06.10.2017	05.04.2019	38 460 687	CHF	919.460	97.586	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	10.04.2017	10.04.2019	35 911 623	CHF	1076.790	96.887	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Ingenico Group	EUR	69.36	19.10.2017	15.04.2019	38 695 193	CHF	84.250	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 18.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.542%	USD	1'000.00	19.04.2017	17.04.2019	35 911 621		-	96.887	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Underlying Tracker on Basket	GBP	1'000.00	18.04.2017	18.04.2019	35 911 795	CHF	1410.530	98.883	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	23.04.2015	23.04.2019	27 062 287	CHF	974.470	94.920	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	20.04.2017	23.04.2019	35 911 572	CHF	972.520	96.990	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	20.10.2017	23.04.2019	38 695 216	CHF	934.390	97.533	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	20.10.2017	23.04.2019	38 695 218	CHF	945.280	97.533	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 25.7.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.598%	USD	1'000.00	27.04.2017	29.04.2019	35 911 784		-	96.965	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 25.7.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	27.04.2017	29.04.2019	35 911 782		-	96.965	100.000		0.000	Y
Market Timer Certificates on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	28.11.2014	02.05.2019	25 322 905	CHF	1308.220	98.421	100.000		0.000	Y
Lock-In Certificates on S&P Global 1200 Dividend Idx	USD	1'000.00	04.05.2015	02.05.2019	27 062 313	%	116.000	94.965	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	05.05.2017	07.05.2019	35 911 999	%	91.050	96.932	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Telefonica 8.5.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	06.05.2016	08.05.2019	31 864 840		-	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	12.05.2017	13.05.2019	35 912 246	CHF	1143.230	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Daxk	USD	1'000.00	16.05.2017	16.05.2019	35 912 268	CHF	960.340	96.831	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	16.05.2017	16.05.2019	35 912 267	CHF	1143.820	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Daxk	EUR	1'000.00	16.05.2017	16.05.2019	35 912 269	CHF	1158.440	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Basket	USD	1'000.00	20.05.2015	20.05.2019	27 062 734	%	90.650	89.589	95.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	18.05.2017	20.05.2019	35 912 012	CHF	1018.320	96.881	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on UniCredit 20.11.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.749%	USD	1'000.00	19.05.2017	20.05.2019	35 912 242		-	96.847	100.000		0.000	Y
Underlying Traker on Equities	EUR	1'000.00	21.11.2017	21.05.2019	38 433 239	%	101.290	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	29.05.2017	27.05.2019	35 912 937	%	101.900	100.000	100.000		0.000	Y
9.6 % Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	31.05.2016	03.06.2019	32 233 274	%	19.500	96.555	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	02.06.2016	04.06.2019	32 023 300	%	113.320	87.099	90.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	08.05.2017	05.06.2019	35 991 551	%	101.100	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 6.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 97.653%	USD	1'000.00	08.06.2017	07.06.2019	35 913 138		-	97.027	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	14.12.2015	17.06.2019	29 386 357	CHF	1305.790	95.457	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Euro Stoxx 50	USD	1'000.00	22.06.2017	24.06.2019	36 779 854	%	98.080	96.997	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	07.07.2016	09.07.2019	32 233 698	%	22.200	97.584	100.000		0.000	Y
Worst Of Bonus Certificates on a Basket of Shs	CHF	1'000.00	11.07.2014	11.07.2019	23 824 672	CHF	1237.000	98.340	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	11.07.2017	11.07.2019	37 044 501	%	98.650	96.978	100.000		0.000	Y
Bonus (Perles Plus) Certificates on S&P 500 Index	USD	1'972.83	16.07.2014	16.07.2019	23 824 863	CHF	2577.480	91.416	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 23.1.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	21.07.2016	22.07.2019	32 647 966		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.07.2017	22.07.2019	37 044 774	%	101.300	100.000	100.000		0.000	Y
Notes on Euro Stoxx 50-Index	EUR	1'000.00	28.07.2014	26.07.2019	23 824 834	%	105.400	96.934	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on UBS Group N	CHF	1'000.00	02.08.2017	02.08.2019	37 174 087	CHF	1004.000	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	08.08.2017	08.08.2019	37 174 057	%	100.500	96.879	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	11.08.2017	13.08.2019	37 174 206	%	98.950	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	17.08.2016	19.08.2019	32 648 294	%	46.650	96.984	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Bristol-MyersSqu	USD	57.67	29.08.2017	29.08.2019	37 590 386	CHF	59.050	96.930	100.000		0.000	Y
Autocallable Certificates on a Basket of Indices 30.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.118%	USD	1.00	05.09.2014	30.08.2019	23 825 016		-	91.377	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	30.08.2017	30.08.2019	37 590 314	%	103.500	96.866	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.09.2017	06.09.2019	37 590 450	%	99.700	96.917	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	06.09.2017	06.09.2019	37 590 452	%	101.800	96.917	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 8.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.86%	NOK	100'000.00	08.09.2016	09.09.2019	33 134 502		-	96.690	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	07.09.2017	09.09.2019	37 590 467	%	101.400	96.951	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	12.09.2017	12.09.2019	37 590 600	%	101.100	100.000	100.000		0.000	Y
Bonus (Perles Plus) Certificates on Euro Stoxx 50 Index	EUR	970.00	13.03.2015	13.09.2019	26 154 599	CHF	1123.920	98.778	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.09.2017	13.09.2019	37 938 834	%	100.600	97.024	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	13.09.2017	13.09.2019	37 938 836	%	99.100	97.024	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	14.09.2017	16.09.2019	37 975 588	%	99.300	97.055	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	14.09.2017	16.09.2019	37 590 634	%	101.900	96.984	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	15.09.2017	17.09.2019	37 925 291	%	101.900	96.997	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	18.09.2017	18.09.2019	37 975 663	%	98.830	96.986	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	22.09.2017	24.09.2019	38 023 891	%	96.530	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	22.09.2017	24.09.2019	38 023 890	%	96.770	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	25.09.2017	25.09.2019	38 023 917	CHF	1143.820	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	05.10.2017	07.10.2019	38 460 649	CHF	943.350	96.658	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	05.10.2017	07.10.2019	38 460 647	CHF	1010.880	96.635	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Synchrony Financ Rg	USD	1'000.00	12.10.2017	11.10.2019	38 498 065	%	101.400	96.599	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	13.10.2017	11.10.2019	38 498 061	%	98.950	96.599	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on So MSCI Wo USD-A-Ac	USD	1'000.00	20.10.2017	21.10.2019	38 695 202	%	99.200	94.977	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	25.04.2017	25.10.2019	35 911 881	%	99.800	96.202	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	25.04.2017	25.10.2019	35 911 878	%	99.700	96.202	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	25.10.2017	28.10.2019	38 695 104	%	99.700	96.546	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	05.05.2017	04.11.2019	35 911 719	%	97.800	95.979	100.000		0.000	Y
Capital Protection Certificates on GS Equity 75/25 Strategy	AUD	1'000.00	07.11.2014	07.11.2019	25 322 681	CHF	820.490	85.483	100.000		0.000	Y
Participation Certificates on GS Risk Premia Return Strategy	USD	1'000.00	07.11.2014	07.11.2019	25 012 612	CHF	1004.680	87.029	95.000		0.000	Y
Participation Certificates on GS Risk Premia Equity Ix	USD	1'000.00	07.11.2014	07.11.2019	25 012 621	CHF	1004.680	87.034	95.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	30.11.2017	29.11.2019	38 433 404	%	100.200	96.330	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Indices	USD	1'000.00	09.06.2017	09.12.2019	35 913 364	%	94.250	91.336	95.000		0.000	Y
Regd.Autocallable Capital Protected Notes on Euro Stoxx 50 Index 11.12.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.582%	USD	1'000.00	11.12.2014	11.12.2019	25 323 087		-	91.831	100.000		0.000	Y
Protected Notes on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	12.12.2014	12.12.2019	25 322 979	%	104.800	91.376	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	18.12.2017	18.12.2019	39 414 155	CHF	969.600	96.111	100.000		0.000	Y
Capital Protected Notes on FTSE 100-Inde x	GBP	1'000.00	23.12.2014	23.12.2019	25 391 881	%	108.600	93.115	100.000		0.000	Y
Protection Participation 2014-27.12.19 on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	09.01.2015	27.12.2019	25 391 822	%	104.100	91.790	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	29.12.2014	30.12.2019	25 391 841	%	107.800	92.089	100.000		0.000	Y
Protection Participation 2014-30.12.19 on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	13.01.2015	30.12.2019	25 391 842	%	108.400	92.089	100.000		0.000	Y
Capital Protected Notes on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	05.01.2015	06.01.2020	25 391 907	%	105.500	91.452	100.000		0.000	Y
Protection Participation 2014-06.01.20 on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	13.01.2015	06.01.2020	25 391 898	%	115.100	82.750	90.000		0.000	Y
Protection Participation 2014-07.01.20 on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	07.01.2015	07.01.2020	25 391 911	%	103.900	91.457	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker auf Russian Depositary	USD	1'000.00	20.07.2017	21.01.2020	37 044 702	CHF	1107.870	95.828	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	07.02.2017	07.02.2020	34 736 159	%	102.100	100.000	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	08.02.2017	10.02.2020	34 736 190	CHF	1111.870	94.951	100.000		0.000	Y
Regd.Bonus Notes on a Basket of Indices	EUR	1'000.00	12.02.2014	12.02.2020	22 861 503	%	130.750	92.396	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	GBP	1'000.00	16.08.2017	17.02.2020	37 174 261	%	98.650	98.339	100.000		0.000	Y
Capital Protected Notes VRN on a Bskt of Currencies	USD	1'000.00	17.02.2015	18.02.2020	26 154 420	%	93.600	93.415	100.000		0.000	Y
Bonus Certificates on S&P 500-Index	USD	1'000.00	12.02.2016	18.02.2020	30 967 507	CHF	1374.980	96.163	100.000		0.000	Y
6 1/2 % Protected Notes on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	19.02.2015	19.02.2020	26 154 500	%	99.800	91.989	100.000		0.000	Y
Outperformance Notes on Basket	EUR	1'000.00	21.02.2014	21.02.2020	22 861 512	%	135.600	74.361	80.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	26.02.2015	26.02.2020	26 154 567	%	100.400	91.953	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	14.03.2016	13.03.2020	31 498 562	%	103.100	99.990	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	14.03.2017	13.03.2020	35 342 260	%	97.550	98.104	100.000		0.000	Y
Protection Participation on USD/MXN	USD	1'000.00	21.03.2017	23.03.2020	35 341 992	%	96.670	94.420	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	23.03.2017	23.03.2020	35 342 499	%	96.550	98.006	100.000		0.000	Y
Autocallable Certificates on a Basket of Indices & Fund	USD	1'000.00	30.03.2015	30.03.2020	26 154 707	%	107.900	73.144	80.000		0.000	Y
1.075 % (pro rata) Reverse Convertible on Equities 2.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	30.03.2017	30.03.2020	35 342 727		-	100.000	100.000	02.10.	0.000	N
Autocallable Certificates on a Basket of Indices & Fund	EUR	1'000.00	01.04.2015	01.04.2020	26 154 752	%	108.100	78.923	80.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 13.10.2017 Vorzeitige Rückzahlung	EUR	1'000.00	24.04.2017	15.04.2020	35 911 690		-	100.000	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Notes auf EUR/USD FIXING 12.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.042%	USD	1'000.00	10.04.2015	16.04.2020	27 062 244		-	92.724	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Glencore Series M	USD	1'000.00	25.04.2017	23.04.2020	35 911 721	%	110.030	94.073	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	USD	1'000.00	05.05.2015	05.05.2020	27 062 546	%	98.800	92.836	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500	USD	1'000.00	05.05.2017	05.05.2020	35 912 149	CHF	967.650	94.985	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	03.11.2017	06.05.2020	38 695 103	%	96.960	95.428	100.000		0.000	Y
Reverse % (pro rata)Convertible on Indices	USD	1'000.00	07.11.2017	08.05.2020	38 877 715	%	97.680	95.474	100.000		0.000	Y
Capital Protected Certificates on S&P Global 1200 Dividend Idx	USD	1'000.00	11.05.2015	11.05.2020	27 062 312	%	103.200	92.403	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	18.05.2015	15.05.2020	27 062 803	%	95.600	92.229	100.000		0.000	Y
Notes on EUR/USD FIXING 15.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 93.574%	USD	1'000.00	11.05.2015	18.05.2020	27 062 726		-	92.147	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Telefonica Br	EUR	1'000.00	17.05.2017	18.05.2020	35 912 336	%	87.500	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.05.2017	19.05.2020	35 912 169	%	99.770	95.014	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	26.05.2015	26.05.2020	27 062 953	%	95.150	91.863	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	CHF	1'000.00	23.05.2017	26.05.2020	35 912 936	CHF	1021.000	100.000	100.000		0.000	Y
Callable Participation Notes on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	28.05.2015	28.05.2020	27 062 980	%	95.100	92.044	100.000		0.000	Y
Protection Participation on SMI	GBP	1'000.00	29.05.2015	29.05.2020	27 062 855	%	99.100	92.520	100.000		0.000	Y
5 % Memory Phoenix Autocallable Certificates on EURO STOXX 50 Index 20.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.232%	EUR	1'000.00	29.05.2015	29.05.2020	27 062 778		-	98.152	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	09.06.2017	09.06.2020	35 913 390	%	96.900	95.212	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	11.06.2015	12.06.2020	27 063 050	%	95.700	92.080	100.000		0.000	Y
Participation Notes on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	12.06.2015	15.06.2020	27 063 070	%	94.800	92.217	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	14.06.2017	15.06.2020	36 779 821	%	96.850	95.271	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	16.06.2017	16.06.2020	36 779 887	CHF	937.440	95.119	100.000		0.000	Y
Autocallable Note on EUR/USD FIXING 16.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	17.06.2015	18.06.2020	27 063 110		-	91.479	100.000		0.000	Y
Autocallable Certificates on Euro Stoxx 50 Index 20.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.225%	EUR	1'000.00	29.05.2015	22.06.2020	27 062 776		-	98.152	100.000		0.000	Y
Participation Notes on Euro Stoxx 50-Index	USD	1'000.00	22.06.2015	22.06.2020	27 680 891	%	97.550	91.295	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	20.06.2017	22.06.2020	36 779 967	%	96.450	92.340	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	22.06.2017	22.06.2020	36 779 855	%	96.540	95.178	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	26.06.2015	26.06.2020	27 680 954	%	96.750	91.295	100.000		0.000	Y
Participation Certificates VRN on a Basket of Indices	USD	1'000.00	29.06.2015	29.06.2020	27 681 057	%	103.800	91.543	100.000		0.000	Y
Capped Bonus Certificates on on Stoxx Europe 600 Banks Ix	EUR	1'000.00	29.06.2015	29.06.2020	27 680 982	%	74.050	97.243	100.000		0.000	Y
Market Timer Certificates on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	29.06.2015	29.06.2020	27 680 981	CHF	1311.730	97.253	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	USD	1'000.00	27.06.2017	29.06.2020	36 780 155	CHF	1026.120	95.156	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P Tranche 82688	USD	1'000.00	28.06.2017	29.06.2020	37 044 440	%	96.850	95.158	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Euro Stoxx 50	USD	1'000.00	30.06.2017	30.06.2020	36 780 131	%	96.220	95.223	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	06.07.2017	06.07.2020	36 779 921	%	97.200	95.001	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	11.07.2017	10.07.2020	37 044 663	%	97.350	94.850	100.000		0.000	Y
Market Timer Certificates on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	13.07.2015	13.07.2020	27 681 191	CHF	1063.150	91.497	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	11.07.2017	13.07.2020	37 044 696	CHF	1035.860	94.850	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	12.07.2017	13.07.2020	37 044 503	%	96.620	94.845	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	14.07.2017	14.07.2020	37 044 635	%	97.450	94.973	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Russell 2000	USD	1'000.00	19.07.2017	20.07.2020	37 044 899	CHF	993.960	94.993	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Protection Participation on HS China Ent Index	USD	1'000.00	24.07.2015	24.07.2020	27 681 311	%	99.600	91.646	100.000		0.000	Y
Protection Participation on HS China Ent Index	USD	1'000.00	27.07.2015	27.07.2020	27 681 333	%	98.750	91.336	100.000		0.000	Y
Participation Notes on Hang Seng China Ent-Index	USD	1'000.00	31.07.2015	31.07.2020	28 230 694	%	99.500	91.502	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	04.08.2017	03.08.2020	37 174 152	CHF	1071.920	94.990	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	06.08.2015	06.08.2020	28 230 732	%	96.650	91.416	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	10.02.2017	10.08.2020	34 736 236	CHF	1312.900	99.986	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	CHF	5'000.00	11.08.2017	11.08.2020	37 174 346	%	98.000	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	17.08.2017	17.08.2020	37 590 199	%	98.700	95.091	100.000		0.000	Y
Protection Participation on HS China Ent Index	USD	1'000.00	20.08.2015	20.08.2020	29 047 228	%	103.800	91.714	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	24.02.2017	24.08.2020	34 736 239	CHF	1267.270	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	24.08.2017	24.08.2020	37 174 145	%	96.520	95.099	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Cuba Opp Idx EUR PR	EUR	100.00	09.09.2016	09.09.2020	32 233 623	CHF	133.160	100.000	100.000		0.000	Y
Protection participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	14.09.2017	14.09.2020	37 590 282	%	96.570	95.417	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on S&P 500 Inf Tec Ind	USD	1'000.00	15.09.2017	15.09.2020	37 590 537	CHF	1045.610	95.355	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Indices	EUR	1'000.00	16.03.2017	16.09.2020	35 341 968	CHF	1252.060	99.855	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	GBP	1'000.00	22.09.2017	22.09.2020	37 975 621	%	98.450	98.217	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	22.09.2017	22.09.2020	37 975 623	%	98.100	95.413	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	USD	1'000.00	22.09.2017	22.09.2020	37 590 511	CHF	1006.630	94.971	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Eni N	EUR	1'000.00	28.09.2017	28.09.2020	38 024 027	%	98.100	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participaton on Euro Stoxx	USD	1'000.00	05.10.2017	05.10.2020	37 938 794	%	96.800	94.697	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	11.10.2017	15.10.2020	38 024 214	%	96.800	89.972	95.000		0.000	Y
Protection Participation on STX HDLB 50 EUR P	USD	1'000.00	16.10.2015	16.10.2020	29 170 028	%	101.400	83.953	90.000		0.000	Y
Phoenix Autocallable Certificates VRN on STOXX Europe 600 Telecom Ix	USD	1'000.00	16.10.2015	16.10.2020	29 170 084	%	90.890	93.059	100.000		0.000	Y
0.2758 % (pro rata) Reverse Convertible on Indices	CHF	1'000.00	25.10.2017	26.10.2020	38 651 852	%	96.350	100.000	100.000	27.11. 27.12.	0.000 0.000	N
Reverse Convertible on Indices 4.5.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 99.323%	EUR	1'000.00	09.10.2015	30.10.2020	29 169 959		-	98.202	100.000		0.000	Y
Dolphin Certificates on Euro Stoxx 50 Index	EUR	1'000.00	30.10.2015	30.10.2020	29 170 019	%	100.500	95.651	97.000		0.000	Y
Protection Participation on Indices	USD	1'000.00	07.11.2017	09.11.2020	38 652 237	%	94.950	94.396	100.000		0.000	Y
(1 % min. - 4 1/2 % max.) floating rate	CHF	1'000.00	13.11.2013	13.11.2020	21 915 842	%	103.100	100.000	100.000	13.02. 15.05. 13.08. 13.11.	2.527 2.527 2.500 2.555	N
(1.8 % min. - 6 % max.) floating rate	EUR	1'000.00	13.11.2013	13.11.2020	21 915 840	%	104.470	100.000	100.000	13.02. 15.05. 13.08. 13.11.	4.850 4.978 5.144 5.283	N
Protection Participation on STX HDLB 50 EUR P	USD	1'000.00	23.11.2015	23.11.2020	29 386 215	%	95.150	82.644	90.000		0.000	Y
Protection Participation on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	30.11.2017	30.11.2020	36 786 658	%	97.840	94.166	100.000		0.000	Y
Protection Participation on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	14.12.2016	14.12.2020	34 468 291	%	100.300	93.557	100.000		0.000	Y
Protection Participation on Euro Stoxx 50 Index	USD	1'000.00	21.12.2017	21.12.2020	38 831 004	%	98.440	93.928	100.000		0.000	Y
(1.4 % Min. - 6 % Max.) floating rate	EUR	1'000.00	23.01.2014	25.01.2021	22 397 665	%	103.600	100.000	100.000	23.01. 24.04. 24.07. 23.10.	3.798 3.826 3.898 4.097	N
Underlying Tracker on Indices	USD	1'000.00	04.08.2017	03.02.2021	37 174 151	CHF	980.320	94.015	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 10.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.725%	USD	1'000.00	10.02.2016	10.02.2021	30 631 977		-	94.250	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 28.2.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 94.938%	USD	1'000.00	26.02.2016	26.02.2021	31 498 577		-	94.474	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	20.09.2017	22.03.2021	37 938 835	CHF	919.900	94.507	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	18.04.2017	14.04.2021	35 911 727	%	100.100	99.864	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	27.04.2017	27.04.2021	35 911 956	%	100.000	99.848	100.000		0.000	Y
Certificates on GS DynaMO Excess Return Index	CHF	1'000.00	06.05.2011	07.05.2021	4 291 687	%	128.800	96.253	122.000		0.000	Y
0.9 % Structured Certificates on SMI Index	CHF	50'000.00	23.05.2011	21.05.2021	4 291 676	%	129.600	106.860	123.000	01.06.	450.00	Y
Reverse Convertible on Equities	EUR	1'000.00	20.11.2017	21.05.2021	36 786 948	%	94.370	100.000	100.000		0.000	Y
Protection Participation on EURO STOXX 50	USD	1'000.00	16.06.2017	16.06.2021	36 779 888	%	95.100	93.175	100.000		0.000	Y
Certificates on GS DynaMO-CHF Excess Return Idx	CHF	1'000.00	08.07.2011	08.07.2021	4 291 688	%	129.800	99.843	123.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Equities	CHF	1'000.00	11.08.2017	11.08.2021	37 173 986	CHF	959.000	100.000	100.000		0.000	Y
Worst of Bonus Certificates on a Basket of Indices	USD	1'000.00	03.09.2015	03.09.2021	29 047 405	CHF	1146.950	89.872	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	USD	1'000.00	14.09.2017	14.09.2021	37 975 589	CHF	1023.710	93.689	100.000		0.000	Y
Protection Participation on STXE S50EURP	USD	1'000.00	15.09.2016	15.09.2021	32 112 306	%	94.450	94.220	100.000		0.000	Y
Protection Participation on STXE S50EURP	USD	1'000.00	14.10.2016	14.10.2021	33 850 793	%	95.750	93.770	100.000		0.000	Y
Underlying Tracker on Basket	USD	1'000.00	16.10.2017	14.10.2021	38 551 214	CHF	972.210	92.472	100.000		0.000	Y
Protection Participation on STXE S50EURP	EUR	1'000.00	26.10.2016	26.10.2021	33 850 851	%	96.350	90.000	90.000		0.000	Y
Protection Participation on Indices 30.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 87.143%	USD	1'000.00	16.10.2015	01.11.2021	29 170 163		-	86.666	95.000		0.000	Y
Protection Participation on STOXX EUROPE 50 EUR INDEX	EUR	1'000.00	03.11.2016	03.11.2021	32 830 122	%	95.550	90.000	100.000		0.000	Y
Capital Protected Certificates on GS DynaMO-CHF ER Idx Reg-S	CHF	1'000.00	04.11.2011	04.11.2021	10 216 182	%	128.000	100.000	116.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities 1.6.2017 Vorzeitige Rückzahlung	USD	1'000.00	01.12.2016	02.12.2021	34 309 542		-	91.008	100.000		0.000	Y
Protection Participation on STOXX Europe Select 50 EUR	USD	1'000.00	16.12.2016	16.12.2021	33 950 571	%	96.900	95.657	105.000		0.000	Y
Underlying Tracker on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	22.12.2016	22.12.2021	34 474 687	%	112.600	99.263	100.000		0.000	Y
Protection Participation on STXE S50EURP Tr 74183	USD	1'000.00	29.12.2016	28.12.2021	34 527 606	%	96.700	94.759	105.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 26.4.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 96.40%	GBP	1'000.00	24.02.2017	24.02.2022	35 341 843		-	96.235	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on S & P/ASX 200	USD	1'000.00	28.02.2017	01.03.2022	35 341 864	%	107.700	90.560	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indicies 23.8.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 92.326%	USD	1'000.00	23.05.2017	23.05.2022	35 913 026		-	91.063	100.000		0.000	Y
Protection Participation on MSCI World	USD	1'000.00	23.06.2017	23.06.2022	36 780 111	%	98.350	91.399	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	28.06.2017	28.06.2022	36 780 234	%	99.400	91.260	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	07.07.2017	07.07.2022	37 044 594	%	98.460	90.907	100.000		0.000	Y
Structured Notes on Equities	USD	1'000.00	26.07.2017	19.07.2022	37 173 840	%	90.260	90.825	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	26.07.2017	19.07.2022	37 044 901	%	93.600	90.825	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	24.07.2017	25.07.2022	37 173 907	%	99.500	90.915	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	10.08.2017	03.08.2022	37 174 150	%	98.140	90.938	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	21.07.2017	05.08.2022	37 044 732	%	100.800	90.596	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	31.08.2017	31.08.2022	37 590 513	%	99.600	91.359	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	31.10.2017	07.11.2022	38 857 795	%	94.350	90.191	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	03.03.2017	03.03.2023	35 341 965	%	109.700	88.900	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	03.03.2017	03.03.2023	35 341 964	%	110.700	88.120	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 16.10.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 89.847%	USD	1'000.00	13.04.2017	17.04.2023	35 911 716		-	88.432	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	09.06.2017	08.06.2023	35 913 360	%	98.700	98.254	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 14.9.2017 Vorzeitige Rückzahlung	CHF	1'000.00	14.06.2017	14.06.2023	36 779 819		-	100.000	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices 14.9.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 90.94%	USD	1'000.00	14.06.2017	14.06.2023	36 779 811		-	89.549	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	16.06.2017	16.06.2023	36 779 893	%	101.000	89.169	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	27.07.2017	27.07.2023	37 173 988	%	99.900	97.470	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	08.09.2017	08.09.2023	37 590 663	%	99.200	89.616	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	1'000.00	02.10.2017	02.10.2023	38 024 122	%	100.800	88.886	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	USD	5'000.00	02.10.2017	02.10.2023	38 024 101	%	100.360	100.000	100.000		0.000	N
Reverse Convertible on Equities	USD	1'000.00	16.10.2017	17.10.2023	38 653 386	%	99.010	88.422	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	USD	1'000.00	18.12.2017	18.12.2023	39 414 131	%	97.050	87.528	100.000		0.000	Y

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

Kombinierte Produkte / Produits combinés / Prodotti combinati

Titel / Titres / Titoli	WMV	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 **31.12.2017** CHF/%		Bondkomponente Composante obligat. Componente obblig. Em.preis prix d'ém. prezzo di em. %	 gar. Rückz. Remb. gar. Rimb. gar. %	Zinsen / Intérêts / Interessi 2017 Datum Date Data	 Brutto brut lordo CHF	IUP
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	08.11.2016	09.11.2026	34 127 346	%	103.700	94.920	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on ESTX50 EUR P	EUR	1'000.00	18.01.2017	18.01.2027	34 735 810	%	104.800	93.197	100.000		0.000	Y
Reverse Convertible on Indices	EUR	1'000.00	18.10.2017	11.10.2027	38 498 060	%	95.100	91.420	100.000		0.000	Y
Regd.Callable Dual Range Accrual Note VRN on Exchange Rate & Interest Rate 30.6.2017 Bondfloor bei vorzeitiger Rückzahlung = 63.92%	USD	1'000.00	30.06.2014	29.06.2029	23 824 682		-	61.000	100.000		0.000	Y

Devisen - Banknoten / Devises - Billets de banque / Divise - Biglietti di banca
31.12.2017

Land Pays Stato	Währung Monnaie Valuta			Freie Devise Devise libre Devisa libera		Kurs für Banknoten Cours pour billets de banque/Corso per biglietti di banca
				VN/NV	CHF	CHF
Ägypten	EGP	Pfund	1	2 826 173	0.054807	0.048500
Albanien	ALL	Lek	100	2 825 737	0.879200	-
Algerien	DZD	Dinar	100	2 825 749	0.849400	-
Angola	AOA	Kwanza	100	2 825 776	0.587300	-
Argentinien	ARS	Peso	1	2 825 786	0.051764	0.051100
Aruba	AWG	Florin	1	2 825 801	0.544395	-
Aserbaidschan	AZN	Manat	100	2 825 921	57.320900	-
Äthiopien	ETB	Birr	100	2 826 190	3.565000	-
Australien	AUD	Dollar	1	2 950 998	0.762188	0.729000
Bahamas	BSD	Dollar	1	2 825 931	0.974475	-
Bahrain	BHD	Dinar	1	2 825 938	2.584253	2.430500
Bangladesh	BDT	Taka	100	2 825 946	1.171500	-
Barbados	BBD	Dollar	1	2 826 005	0.487237	0.474000
Belarus	BYN	Rubel	100	32 542 411	49.365000	-
Belize	BZD	Dollar	1	2 826 021	0.487542	0.476000
Bermuda	BMD	Dollar	1	2 826 026	0.974475	0.901500
Bhutan	BTN	Ngultrum	1	2 826 032	0.015267	-
Bolivien	BOB	Boliviano	100	2 826 041	14.102300	13.600000
Botswana	BWP	Pula	1	2 826 057	0.099151	0.091600
Brasilien	BRL	Real	1	2 826 063	0.293771	0.290200
Britisch Westindien	XCD	Dollar	100	2 826 090	36.091700	34.500000
Brunei	BND	Dollar	1	2 826 067	0.729178	0.677000
Bulgarien	BGN	Lew	1	2 826 073	0.598251	0.549500
Burundi	BIF	Franc	100	2 826 077	0.055400	-
Chile	CLP	Peso	100	2 826 103	0.158400	0.157500
China (Volksrepublik)	CNY	Yuan	100	2 826 107	14.964200	14.430000
China (Volksrepublik)	CNH	Offshore Renminbi Yuan	100	20 415 349	14.964100	-
Communauté Fin. Africaine	XOF	Franc CFA	100	2 826 466	0.178300	-
Costa Rica	CRC	Colon	100	2 826 123	0.171100	0.172000
Dänemark	DKK	Krone	100	2 951 004	15.716400	15.050000
Dominikanische Republik	DOP	Peso	100	2 826 164	2.013500	2.000000
Europäische Währungsunion	EUR	Euro	1	2 951 012	1.170150	1.146500
Fidschi	FJD	Dollar	1	2 825 972	0.478070	0.460000
Gambia	GMD	Dalasi	1	2 826 049	0.020446	-
Georgien	GEL	Lari	1	2 826 055	0.377699	-
Ghana	GHS	Cedi	100	3 207 528	21.547100	-
Grossbritannien	GBP	Pfund	1	2 951 154	1.318256	1.263000
Guatemala	GTQ	Quetzal	1	2 826 125	0.132675	0.128500
Guinea	GNF	Franc	100	2 826 133	0.010700	-
Haiti	HTG	Gourde	100	2 826 148	1.519900	-
Honduras	HNL	Lempira	100	2 826 159	4.131200	-
Hongkong	HKD	Dollar	100	2 951 019	12.465500	11.990000
Indien	INR	Rupie	100	2 826 171	1.526700	1.480000
Indonesien	IDR	Rupiah	100	2 826 186	0.007182	0.006800
Island	ISK	Krone	100	2 951 026	0.941700	0.904000
Israel	ILS	Schekel	100	2 826 217	28.069500	26.000000
Jamaika	JMD	Dollar	100	2 826 227	0.782200	0.757500
Japan	JPY	Yen	100	2 951 035	0.865000	0.834000
Jordanien	JOD	Dinar	1	2 826 231	1.374464	1.350000
Kaimaninseln	KYD	Dollar	1	2 826 096	1.188391	1.143500
Kanada	CAD	Dollar	1	2 951 042	0.777766	0.749500
Kasachstan	KZT	Tenge	100	2 826 239	0.292800	-
Katar	QOF	Riyal Offshore	100	39 671 125	26.480200	26.450000
Kenia	KES	Schilling	100	2 826 265	0.943800	0.925000
Kirgisistan	KGS	Som	1	2 826 309	0.014094	-
Kolumbien	COP	Peso	100	2 826 112	0.032600	0.032100
Kongo (Dem. Republik)	CDF	Franc	100	2 826 274	0.061000	-
Korea (Republik)	KRW	Won	100	2 826 287	0.091000	0.088500
Kroatien	HRK	Kuna	100	2 826 126	15.718600	14.410000
Kuba	CUC	Peso Convertible	1	29 947 751	0.974475	-
Kuwait	KWD	Dinar	1	2 826 300	3.228890	3.020000
Lesotho	LSL	Loti	1	2 826 335	0.078713	-
Libanon	LBP	Pfund	100	2 826 331	0.064300	0.063300
Macau	MOP	Pataca	1	2 826 362	0.121025	0.114800
Madagaskar	MGA	Ariary	100	2 826 204	0.030000	-
Malawi	MWK	Kwacha	1	2 826 213	0.001342	-
Malaysia	MYR	Ringgit	100	2 826 220	24.079100	23.600000

Devisen - Banknoten / Devises - Billets de banque / Divise - Biglietti di banca
31.12.2017

Land Pays Stato	Währung Monnaie Valuta			Freie Devise Devise libre Devisa libera		Kurs für Banknoten Cours pour billets de banque/Corso per biglietti di banca
				VN/NV	CHF	CHF
Malediven	MVR	Rufiyaa	1	2 826 226	0.063236	0.061600
Marokko	MAD	Dirham	100	2 826 268	10.425900	9.400000
Mauretanien	MRO	Ouguiya	100	2 826 240	0.274900	-
Mauritius	MUR	Rupie	1	2 826 245	0.028830	0.027500
Mazedonien	MKD	Denar	100	2 826 199	1.899900	-
Mexiko	MXN	Peso	100	2 329 966	4.980500	4.650000
Moldau	MDL	Leu	1	2 826 254	0.056962	-
Mongolei	MNT	Tugrik	100	2 826 259	0.040100	-
Mosambik	MZN	Metical	100	2 826 282	1.651600	-
Namibia	NAD	Dollar	1	2 826 293	0.078713	0.077000
Nepal	NPR	Rupie	1	2 826 301	0.009542	0.009100
Neuseeland	NZD	Dollar	1	2 951 055	0.693052	0.665500
Nicaragua	NIO	Cordoba	100	2 826 333	3.165600	-
Niederländische Antillen	ANG	Gulden	100	2 826 321	54.439500	-
Nigeria	NGN	Naira	100	2 826 342	0.270600	-
Norwegen	NOK	Krone	100	2 951 079	11.913800	11.360000
Oman	OMR	Rial	1	2 826 352	2.530874	2.371500
Pakistan	PKR	Rupie	100	2 826 356	0.883000	0.860000
Panama	PAB	Balboa	1	2 826 481	0.974475	-
Papua-Neuguinea	PGK	Kina	1	2 826 486	0.302861	-
Paraguay	PYG	Guarani	100	2 826 489	0.017400	-
Peru	PEN	Sol	100	2 826 490	30.071700	29.500000
Philippinen	PHP	Peso	100	2 826 492	1.952000	1.890000
Polen	PLN	Zloty	100	2 951 095	28.044300	26.640000
Ruanda	RWF	Franc	100	2 826 521	0.114100	-
Rumänien	RON	Leu	100	2 826 503	25.063700	24.850000
Russland	RUB	Rubel	100	2 826 507	1.692600	1.660000
Salomonen	SBD	Dollar	1	2 826 401	0.125292	-
Salvador, El	SVC	Colon	100	2 826 179	11.136800	-
Sambia	ZMW	Kwacha	1	19 934 263	0.097691	-
Samoa	WST	Tala	1	2 826 526	0.388321	-
Saudi-Arabien	SAR	Riyal	100	2 826 533	25.983900	24.620000
Schweden	SEK	Krone	100	2 951 100	11.902000	11.370000
Serbien	RSD	Dinar	100	2 826 541	0.989500	0.955000
Seychellen	SCR	Rupie	1	2 826 599	0.071547	0.069000
Sierra Leone	SLL	Leone	100	2 826 607	0.012700	-
Singapur	SGD	Dollar	100	2 951 110	72.917800	68.200000
Sri-Lanka (Ceylon)	LKR	Rupie	100	2 826 410	0.634800	0.600000
Südafrika	ZAR	Rand	1	2 951 118	0.078713	0.075200
Suriname	SRD	Dollar	100	2 826 415	13.066100	-
Swasiland	SZL	Lilangeni	1	2 826 419	0.078713	0.066500
Taiwan (Formosa)	TWD	Dollar	100	2 826 426	3.274600	3.170000
Tansania	TZS	Schilling	100	2 826 430	0.043400	-
Thailand	THB	Baht	100	2 826 432	2.990100	2.802000
Tonga	TOP	Pa'anga	1	2 826 434	0.445304	-
Trinidad und Tobago	TTD	Dollar	100	2 826 436	14.407700	14.250000
Tschechische Republik	CZK	Krone	100	2 951 122	4.583600	4.360000
Tunesien	TND	Dinar	1	2 826 439	0.390245	-
Türkei	TRY	Lira	1	2 121 050	0.257009	0.257000
Uganda	UGX	Schilling	100	2 826 440	0.026700	-
Ukraine	UAH	Hrywnja	1	2 826 443	0.034715	-
Ungarn	HUF	Forint	100	2 951 133	0.377200	0.357500
Uruguay	UYU	Peso	100	2 826 449	3.387100	3.350000
USA	USD	Dollar	1	2 951 145	0.974475	0.945500
Usbekistan	UZS	Sum	100	2 826 453	0.012000	-
Vanuatu	VUV	Vatu	100	2 826 456	0.888700	0.887500
Venezuela	VEF	Bolivar Fuerte	100	3 345 269	0.029100	-
Vereinigte Arabische Emirate	AED	Dirham	100	2 826 446	26.532200	24.780000
Vietnam	VND	Dong	100	2 826 462	0.004291	0.004200
Virtuelle Währungen	BTC	Bitcoin	1	39 714 275	13784.380000	-
	BCH	BitcoinCash	1		2343.590000	-
	ADA	Cardano	1		0.710000	-
	ETH	Ethereum	1		721.520000	-
	IOT	IOTA	1		3.420000	-
	LTC	Litecoin	1		222.340000	-
	XEM	NEM	1		1.000000	-
	XRP	Ripple	1		1.990000	-
	XLM	Stellar	1		0.350000	-
	TRX	TRON	1		0.040000	-

Goldmünzen und Edelmetalle / Monnaies d'or et métaux précieux
Monete d'oro e metalli preziosi

			Valoren Nr. No de valeur Numero di valore	Steuerwert Val. imposable Val. imponibile **31.12.2017** CHF
Gemünztes Gold / Or monnayé / Oro monetato (zum Goldpreis)				
Schweiz / Suisse / Svizzera	Vreneli	Fr. 20.-	281 383	235.80
Belgien / Belgique / Belgio		Fr. 20.-	281 826	235.80
Frankreich / France / Francia	Napoléon	Fr. 20.-	282 051	235.80
Grossbritannien / Grande-Bretagne / Gran-Bretagna	Sovereign	£ 1.- Victoria	281 720	297.35
	Sovereign	£ 1.- neu	281 719	297.35
Italien / Italie / Italia		Lit. 20.-	282 299	235.80
Österreich / Autriche / Austria	Kronen	100.-	281 781	1'238.30
Neuprägungen (Australien, Grossbritannien, Kanada, Südafrika, USA, usw.)		1/10 Unze	281 626	126.34
		1/4 Unze	281 627	315.85
		1/2 Unze	281 628	631.70
		1 Unze	281 624	1'263.40
Gold / Or / Oro				
Barren per kg Feingold / Lingots par kg d'or fin / Barra per kg d'oro fino			274 701	40'619.45
per Unze Feingold (Originalbetrag: USD 1296.50)	1 Unze			
par once d'or fin (Montant original: USD 1296.50)	1 once	= 31.1034768 g	281 179	1'263.40
per oncia d'oro fino (Importo originale: USD 1296.50)	1 oncia			
Palladium / Palladio				
Barren per kg brutto/netto / Lingots par kg brut/net / Barra per kg lordo/netto			287 634	33'115.90
per Unze brutto/netto (Originalbetrag: USD 1057.00)	1 Unze			
par once brut/net (Montant original: USD 1057.00)	1 once	= 31.1034768 g	287 642	1'030.00
per oncia lordo/netto (Importo originale: USD 1057.00)	1 oncia			
Platin / Platine / Platino				
Barren per kg brutto/netto / Lingots par kg brut/net / Barra per kg lordo/netto			287 657	28'980.30
per Unze brutto/netto (Originalbetrag: USD 925.00)	1 Unze			
par once brut/net (Montant original: USD 925.00)	1 once	= 31.1034768 g	287 639	901.35
per oncia lordo/netto (Importo originale: USD 925.00)	1 oncia			
Silber / Argent / Argento				
Barren per kg brutto/netto / Lingots par kg brut/net / Barra per kg lordo/netto			274 706	528.35
per Unze brutto/netto (Originalbetrag: USD 16.865)	1 Unze			
par once brut/net (Montant original: USD 16.865)	1 once	= 31.1034768 g	287 628	16.40
per oncia lordo/netto (Importo originale: USD 16.865)	1 oncia			

Devisen-Jahresmittelkurse in der Schweiz / Cours annuels moyens des devises en Suisse
Corsi annui medi delle divise in Svizzera

Devisen-Jahresmittelkurse der wichtigsten Staaten, mit denen die Schweiz ein Doppelbesteuerungsabkommen abgeschlossen hat / Cours annuels moyens des devises des principaux Etats étrangers avec lesquels la Suisse a conclu une convention de double imposition / Corsi annui medi delle divise dei principali Stati estere con i quali la Svizzera ha concluso una convenzione di doppia imposizione

Vertragsstaat Etat contractant Stato contraente	Währung Monnaie Valuta			Jahresmittelkurs Cours annuel moyen Corso annuo medio 2017 CHF
Belgien - Belgique - Belgio	BEF	Franc	100	2.75550962
Dänemark - Danemark -Danimarca	DKK	Krone	100	14.94273077
Deutschland - Allemagne - Germania	DEM	Mark	100	56.83373077
Finnland -Finlande - Finlandia	FIM	Mark	100	18.69511538
Frankreich - France -Francia	FRF	Franc	100	16.94557692
Griechenland - Grèce - Grecia	GRD	Drachme	100	0.32621385
Grossbritannien - Grande-Bretagne - Gran Bretagna	GBP	Pfund	1	1.26807115
Irland - Irlande - Irlanda	IEP	Pfund	1	1.41140346
Italien - Italie - Italia	ITL	Lira	100	0.05740615
Niederlande - Pays-Bas - Paesi Bassi	NLG	Gulden	100	50.44061538
Norwegen - Norvège - Noprvegia	NOK	Krone	100	11.91380769
Österreich - Autriche - Austria	ATS	Schilling	100	8.07808885
Polen - Pologne - Polonia	PLN	Zloty	100	26.11353846
Portugal - Portogallo	PTE	Escudos	100	0.55444846
Russland - Russie - Russia	RUB	Rubel	100	1.68907692
Schweden - Suède - Svezia	SEK	Krone	100	11.53473077
Spanien - Espagne - Spagna	ESP	Peseta	100	0.66806846
Tschechische Republik - République Tchèque - Repubblica Ceca	CZK	Krone	100	4.22500154
Türkei - Turquie - Turchia	TRY	Lira	1	0.27003538
Ungarn - Hongrie - Ungheria	HUF	Forint	100	0.35948077
Europäische Währungseinheit - Unité monétaire européenne - Unità monetaria europea	EUR	Euro	1	1.11156946
Kanada - Canada - Canadà	CAD	Dollar	1	0.75874423
Mexiko - Mexique - Messico	MXN	Peso	100	5.21588462
USA	USD	Dollar	1	0.98461269
Argentinien - Argentine - Argentina	ARS	Peso	1	0.05970192
Brasilien - Brésil - Brasile	BRL	Real	1	0.30847308
Südafrika - Afrique du Sud - Africa del Sud	ZAR	Rand	1	0.07398346
China (Volksrepublik)	CNY	Yuan	100	14.58557308
Hongkong	HKD	Dollar	100	12.636140
Indien	INR	Rupie	100	1.51253846
Japan - Japon - Giappone	JPY	Yen	100	0.87776923
Korea (Süd) - Corée du Sud - Corea del Sud	KRW	Won	100	0.08705423
Malaysia - Malaisie - Malesia	MYR	Ringgit	100	22.904500
Singapur - Singapour - Singapore	SGD	Dollar	100	71.30307692
Thailand - Thaïlande - Tailandia	THB	Baht	100	2.90227308
Australien - Australie - Australia	AUD	Dollar	1	0.75458192
Neuseeland - Nouvelle-Zélande - Nuova Zelanda	NZD	Dollar	1	0.69952692

Quelle: Schweiz. Nationalbank / Source: Banque Nationale Suisse / Fonte: Banca Nazionale Svizzera

Doppelbesteuerungsabkommen

Die Erträgnisse der in dieser Liste enthaltenen ausländischen Wertpapiere unterliegen zum Teil ausländischen Quellensteuern. Die meisten der von der Schweiz abgeschlossenen Doppelbesteuerungsabkommen (DBA) sehen die volle oder teilweise Entlastung von diesen Steuern vor.
Die DBA ordnen zudem an, dass die Schweiz für den nicht rückforderbaren Teil der ausländischen Steuern die **pauschale Steueranrechnung** zu gewähren hat (vgl. hiezu Verordnung des Bundesrates vom 22. August 1967 / 18. Juli 2006 und Merkblatt DA-M vom Mai 2003). (D) Erträgnisse aus den in Frage kommenden Vertragsstaaten sind deshalb mit dem Bruttobetrag eingesetzt. Die Angaben über die aus den übrigen Vertragsstaaten stammenden Erträgnisse tragen der Entlastung von der ausländischen Quellensteuer bereits Rechnung.
Die Entlastung ist in der Regel in einem besonderen Verfahren zu beantragen, dass in den Länderübersichten kurz erwähnt wird. „Quelle" bedeutet Entlastung an der Quelle anlässlich der Auszahlung oder Gutschrift der Einkünfte; „Erstattung" bedeutet nachträgliche Erstattung. Die hierfür zu verwendenden Antragsformulare und Merkblätter, sind auf Internet aufgeschaltet und zum grössten Teil nicht mehr in Papierform verfügbar. Sie werden von dort wie folgt heruntergeladen: www.estv.admin.ch, Formulare, - die wichtigsten Unterlagen, Formulare Verrechnungssteuer, Ausländische Quellensteuer. Formulare und Merkblätter, die nicht im Internet verfügbar sind, können per E-Mail verkauf.zivil@bbl.admin.ch bestellt werden. Die Formulare mit denen die Erstattung des zusätzlichen Steuerrückbehalts USA und die pauschale Steueranrechnung zu beantragen sind, werden von den kantonalen Steuerverwaltungen abgegeben.

Die Erstattung erhobener Quellensteuern ist in der Regel innerhalb von drei Jahren zu verlangen. Für gewisse Länder gelten kürzere oder längere Fristen. Für Einzelheiten sind die Anmerkungen auf den Formularen und Merkblätter zu beachten.
Einschränkungen des Anspruchs auf Entlastung von ausländischen und schweizerischen Steuern ergeben sich für bestimmte Ertragsempfänger aus dem Bundesratsbeschluss vom 14. Dezember 1962 betreffend Massnahmen gegen die ungerechtfertigte Inanspruchnahme von Doppelbesteuerungsabkommen des Bundes und aus einigen Abkommen (vgl. auch www.sif.admin.ch / Themen / Internationale Steuerpolitik / Doppelbesteuerung (DBA) / DBA-Missbrauch).
Eine Zusammenstellung der Entlastungen enthält die von der Eidgenössischen Steuerverwaltung herausgegebene Sammlung „Steuerentlastungen aufgrund von Doppelbesteuerungsabkommen" (vgl. auch www.estv.admin.ch / Internationales Steuerrecht / Themen / Quellensteuer nach DBA).

Hinweis: Sieht ein Doppelbesteuerungsabkommen für Dividenden ab einem bestimmten Beteiligungsgrad einen tieferen Quellensteuersatz vor, findet dieser tiefere Satz nur Anwendung auf Dividenden, die an eine Gesellschaft gezahlt werden.

Für die aktuelle Übersicht über die Entlastung der Dividenden und Zinsen von ausländischen Steuern wird auf die Verordnung 1 des EFD über die pauschale Steueranrechnung vom 6. Dezember 1967 verweisen, die unter folgendem Link abgerufen werden kann:
www.admin.ch/ch/d/sr/c672_201_1.html

Conventions en vue d'éviter les doubles impositions

Les revenus de plusieurs titres étrangers figurant dans cette liste sont soumis aux impôts à la source étrangers. La plupart des conventions de double imposition conclues par la Suisse prévoient le dégrèvement total ou partiel de ces impôts à la source.
Les conventions prévoient en outre que la Suisse doit accorder **l'imputation forfaitaire** pour la part non récupérable des impôts étrangers (voir à ce sujet l'ordonnance du Conseil fédéral du 22 août 1967 / 18 juillet 2006 et la notice DA-M de mai 2003). (D) Les revenus provenant des Etats contractants en question sont donc indiqués à leur montant brut. Les données concernant les revenus provenant des autres Etats contractants tiennent déjà compte du dégrèvement des impôts à la source.
En général le dégrèvement est accordé à la suite d'une procédure spéciale, résumée dans l'aperçu des pays. „Source" signifie dégrèvement à la source lors du paiement ou de la bonification des revenus; „Remb" signifie remboursement ultérieur. La plupart des formules de demande et des notices sont exclusivement disponibles sur l'internet et peuvent être téléchargées comme suit : www.estv.admin.ch, Thèmes fiscaux Impôt Anticipé, Services - Formulaires, Impôt à la source étranger. Les formules de demande et les notices qui ne se trouvent pas sur l'internet peuvent être commandées par courriel « verkauf.zivil@bbl.admin.ch ». Les formules servant à demander le remboursement de la retenue supplémentaire d'impôt USA et l'imputation forfaitaire d'impôt sont remises par les administrations cantonales des contributions.

Dans la règle, le remboursement des impôts prélevés à la source doit être demandé dans un délai de trois ans. Des délais plus courts ou plus longs sont applicables pour certains pays. Pour les détails on se reportera aux remarques dans les formules et dans les notices éventuelles.
Des restrictions du droit au dégrèvement des impôts étrangers et suisses résultent, pour certains bénéficiaires de revenus, de l'arrêté du Conseil fédéral du 14 décembre 1962 instituant des mesures contre l'utilisation sans cause légitime des conventions de double imposition conclues par la Confédération et de quelques conventions (voir www.sif.admin.ch/Thèmes/Politique fiscale internationale/Double imposition (CDI) / Abus des conventions).
La documentation publiée par l'Administration fédérale des contributions sous le titre „Dégrèvements des impôts sur la base des conventions de double imposition" comprend une récapitulation des dégrèvements (voir www.estv.admin.ch / Droit fiscal International / Thèmes/ Impôts à la source selon CDI).

Note : Lorsqu'une Convention prévoit, pour les dividendes provenant de participations d'un certain degré, un impôt à la source à un taux inférieur, ce taux réduit ne s'applique qu'aux dividendes payés à une société.

Les indications actuelles concernant le dégrèvement des impôts étrangers sur les dividendes et intérêts sont disponibles sur l'Ordonnance 1 du DFF relative à l'imputation forfaitaire d'impôt, qui peut être consultée à l'adresse suivante :
www.admin.ch/ch/f/sr/c672_201_1.html

Convenzioni intese ad evitare le doppie imposizioni

I redditi di una parte dei titoli stranieri che figurano nel presente listino sono soggetti ad imposte straniere prelevate alle fonte. La maggior parte delle convenzioni di doppia imposizione (CDI) concuse dalla Svizzera prevede lo sgravio totale o parziale di queste imposte alla fonte.
Le convenzioni prevedono inoltre che la Svizzera debba accordare il **computo globale** per la parte non recuperabile dell'imposta straniera (cfr. ordinanza del Consiglio federale del 22 agosto 1967 / 18 luglio 2006 e Promemoria DA-M del maggio 2003). (D) I redditi provenienti dagli Stati contraenti in questione sono perciò indicati con l'importo lordo. Le indicazioni concernenti i redditi provenienti dagli altri Stati contraenti tengono già conto dello sgravio dell'imposta straniera alla fonte.
In genere lo sgravio è concesso con una procedura speciale, riassunta nel compendio dei Paesi. „Fonte" significa sgravio alla fonte al momento del pagamento o dell'accredito dei redditi; „Rimborso" significa rimborso successivo. La maggior parte dei moduli di richiesta e delle relative istruzioni sono disponibili solo su internet e possono essere scaricati all'indirizzo seguente: www.estv.admin.ch, I moduli e la documentazione più importante, Moduli per imposta preventiva, Imposta alla fonte esteri. Moduli ed istruzioni che non sono pubblicati su internet possono essere ordinati per email a "verkauf.zivil@bbl.admin.ch". I moduli per il rimborso della ritenuta supplementare d'imposta USA e per il computo globale d'imposta sono rilasciati dalle amministrazioni cantonali delle contribuzioni.

Di regola, il rimborso delle imposte prelevate alla fonte deve essere chiesto nel termine di tre anni. Dei termini più brevi o più lunghi sono applicabili ad alcuni paesi. Per le particolarità si devono osservare le note indicate sui moduli e promemoria.
Restrizioni del diritto allo sgravio delle imposte straniere e svizzere risultano, per i determinati beneficiari di redditi, dal decreto del Consiglio federale del 14 dicembre 1962 concernente i provvedimenti contro l'uso senza causa legittima delle convenzioni conchiuse dalla Confederazione per evitare le doppie imposizioni e da alcune convenzioni (vedi www.sif.admin.ch/Thèmes/Politique fiscale internationale/Double imposition (CDI) / Abus des conventions).
La documentazione pubblicata dall'Amministrazione federale delle contribuzioni sotto il titolo „Steuerentlastungen aufgrund von Doppelbesteuerungsabkommen" / „Dégrèvements des impôts sur la base des conventions de double imposition" contiene un riepilogo degli sgravi (vedi www.estv.admin.ch / Droit fiscal International / Thèmes/ Impôts à la source selon CDI).

Nota: Se una convenzione prevede, con riguardo ai dividendi da partecipazione di una certa misura, un'imposta alla fonte ad un tasso inferiore, questo tasso inferiore non si applica che per i dividendi pagati ad una società.

La tavola sinottica dello sgravio delle imposte straniere su dividendi e interessi è disponibile su l'Ordinanza 1 del DFF sul computo globale d'imposta che può essere consultata al seguente indirizzo:
www.admin.ch/ch/i/sr/c672_201_1.html

© Copyright by Eidg. Steuerverwaltung, 3003 Bern
02.18 1600 860413119