UBS

Asset management
UBS Funds

# Halbjahresbericht 2016

**Anlagefonds luxemburgischen Rechts**

**R.C.S. Luxemburg N° B 154 210**

**Ungeprüfter Halbjahresbericht per 30. September 2016**

UBS (Lux) Bond Fund
UBS (Lux) Bond Fund – AUD
UBS (Lux) Bond Fund – CAD
UBS (Lux) Bond Fund – CHF
UBS (Lux) Bond Fund – Convert Europe (EUR)
UBS (Lux) Bond Fund – EUR
UBS (Lux) Bond Fund – Euro High Yield (EUR)
UBS (Lux) Bond Fund – Full Cycle Asian Bond (USD)
UBS (Lux) Bond Fund – GBP
UBS (Lux) Bond Fund – Global (CHF)
UBS (Lux) Bond Fund – USD



# Ungeprüfter Halbjahresbericht per 30. September 2016


| Inhaltsverzeichnis | Seite | | ISIN |
|---|---|---|---|
| Management und Verwaltung | 3 | | |
| Charakteristik des Fonds | 5 | | |
| UBS (Lux) Bond Fund | 11 | | |
| UBS (Lux) Bond Fund – AUD | 13 | F-acc | LU0415157832 |
| | | I-A1-acc | LU0415158210 |
| | | I-X-acc | LU0415159374 |
| | | N-acc | LU0415156602 |
| | | P-acc | LU0035338325 |
| | | P-dist | LU0035338242 |
| | | Q-acc | LU0415158053 |
| | | Q-dist | LU0415157915 |
| UBS (Lux) Bond Fund – CAD | 19 | F-acc | LU0415160620 |
| | | P-acc | LU0033048686 |
| | | P-dist | LU0033047795 |
| | | Q-acc | LU0415160976 |
| | | Q-dist | LU0415160893 |
| UBS (Lux) Bond Fund – CHF | 21 | F-acc | LU0415163566 |
| | | F-dist | LU0415163483 |
| | | I-A1-acc | LU0415164028 |
| | | I-A3-acc | LU0415164531 |
| | | N-acc | LU0415162758 |
| | | P-acc | LU0010001369 |
| | | P-dist | LU0010001286 |
| | | Q-acc | LU0415163723 |
| | | Q-dist | LU0415163640 |
| UBS (Lux) Bond Fund – Convert Europe (EUR) | 28 | F-acc | LU0415178838 |
| | | I-A1-acc | LU0415179133 |
| | | (CHF hedged) I-A1-acc | LU1331651429 |
| | | I-A1-dist | LU0804734944 |
| | | I-X-acc | LU0415180065 |
| | | (CHF hedged) I-X-acc | LU1415541744 |
| | | I-X-dist | LU0415179992 |
| | | K-1-acc | LU0415178242 |
| | | P-acc | LU0108066076 |
| | | (CHF hedged) P-acc | LU0776290768 |
| | | P-dist | LU0108060624 |
| | | Q-acc | LU0358408184 |
| | | (CHF hedged) Q-acc | LU1240769197 |
| | | Q-dist | LU0415178911 |
| | | U-X-dist | LU0415180149 |
| UBS (Lux) Bond Fund – EUR | 35 | F-acc | LU0415166403 |
| | | F-dist | LU0415166312 |
| | | N-acc | LU0168863511 |
| | | P-acc | LU0033050237 |
| | | P-dist | LU0033049577 |
| | | Q-acc | LU0358407707 |
| | | Q-dist | LU0415166585 |
| UBS (Lux) Bond Fund – Euro High Yield (EUR) | 41 | F-acc | LU0415181469 |
| | | I-A1-acc | LU0415181899 |
| | | I-A2-acc | LU1368322555 |
| | | I-B-acc | LU0415182517 |
| | | I-B-mdist | LU0908558249 |
| | | I-X-acc | LU0415182780 |
| | | (CHF hedged) I-X-acc | LU0654646750 |
| | | (USD hedged) K-1-6%-mdist | LU1230129923 |
| | | K-1-acc | LU0415180909 |
| | | (USD hedged) K-1-acc | LU1004765761 |
| | | (RMB hedged) K-1-mdist | LU1030385881 |
| | | (USD hedged) K-1-mdist | LU1329801796 |
| | | N-dist | LU0415180495 |
| | | P-6%-mdist | LU1076698254 |
| | | P-acc | LU0086177085 |
| | | (CHF hedged) P-acc | LU0776290842 |
| | | (USD hedged) P-acc | LU0994471687 |
| | | P-dist | LU0085995990 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | | P-mdist | LU0417441200 |
| | | (JPY) P-mdist | LU1318703292 |
| | | (AUD hedged) P-mdist | LU0945635778 |
| | | (CAD hedged) P-mdist | LU0945635851 |
| | | (GBP hedged) P-mdist | LU0997192736 |
| | | (HKD hedged) P-mdist | LU0973218331 |
| | | (RMB hedged) P-mdist | LU0968750884 |
| | | (SGD hedged) P-mdist | LU0989134753 |
| | | (USD hedged) P-mdist | LU0937166394 |
| | | Q-6%-mdist | LU1240770286 |
| | | (USD hedged) Q-6%-mdist | LU1317082110 |
| | | Q-acc | LU0358408267 |
| | | (CHF hedged) Q-acc | LU1240769437 |
| | | (USD hedged) Q-acc | LU1240770013 |
| | | Q-dist | LU0415181543 |
| | | Q-mdist | LU1240770369 |
| | | (GBP hedged) Q-mdist | LU1240769510 |
| | | (USD hedged) Q-mdist | LU1240770104 |
| UBS (Lux) Bond Fund – Full Cycle Asian Bond (USD) | 56 | F-acc | LU0464245496 |
| | | (EUR hedged) F-acc | LU0464251627 |
| | | (SGD hedged) F-acc | LU0964819261 |
| | | I-A1-acc | LU0464245819 |
| | | I-X-acc | LU0464246890 |
| | | I-X-dist | LU0464246627 |
| | | (EUR hedged) N-acc | LU0464250819 |
| | | P-acc | LU0464244333 |
| | | (EUR hedged) P-acc | LU0464250652 |
| | | (SGD hedged) P-acc | LU0464247518 |
| | | (EUR hedged) P-dist | LU0464250496 |
| | | P-mdist | LU0464244259 |
| | | (SGD hedged) P-mdist | LU0464247435 |
| | | Q-acc | LU0464245652 |
| | | (EUR hedged) Q-acc | LU0464251973 |
| | | (EUR hedged) Q-dist | LU0464251890 |
| | | Q-mdist | LU0464245579 |
| UBS (Lux) Bond Fund – GBP | 64 | F-acc | LU0415169761 |
| | | P-acc | LU0035346187 |
| | | P-dist | LU0035345882 |
| | | Q-acc | LU0415169928 |
| | | Q-dist | LU0415169845 |
| UBS (Lux) Bond Fund – Global (CHF) | 70 | (CAD hedged) F-acc | LU1467593940 |
| | | I-B-acc | LU0415185379 |
| | | P-acc | LU0071006638 |
| | | (CAD hedged) P-acc | LU1467572357 |
| | | (EUR hedged) P-acc | LU0487186396 |
| | | (JPY hedged) P-acc | LU0817644254 |
| | | P-dist | LU0071005408 |
| | | (CAD hedged) P-dist | LU1467578123 |
| | | (EUR hedged) P-dist | LU0487186123 |
| | | (JPY hedged) P-dist | LU0817644841 |
| | | Q-acc | LU0415184216 |
| | | (CAD hedged) Q-acc | LU1467583982 |
| | | Q-dist | LU0415184133 |
| | | (CAD hedged) Q-dist | LU1467589328 |
| | | U-X-acc | LU0415185700 |
| UBS (Lux) Bond Fund – USD | 83 | F-acc | LU0415176030 |
| | | P-acc | LU0035346773 |
| | | P-dist | LU0035346344 |
| | | Q-acc | LU0415176204 |
| | | Q-dist | LU0415176113 |

Erläuterungen zum Halbjahresbericht 89


## Verkaufsrestriktionen

Innerhalb der USA dürfen Anteile dieses Fonds weder angeboten noch verkauft oder ausgeliefert werden.

## Internetadresse

http://www.ubs.com/1/g/globalam/funds.html

# Management und Verwaltung

**Verwaltungsgesellschaft**

UBS Fund Management (Luxembourg) S.A.,
33A, avenue J.F. Kennedy,
L-1855 Luxemburg
R.C.S. Luxemburg N° B 154 210

**Verwaltungsrat**

*Andreas Schlatter,* Präsident
Independent Director, Küttigen, Schweiz

*Pascal Kistler*
Managing Director, UBS AG, Basel und Zürich

*Martin Thommen,* Mitglied
Managing Director, UBS AG, Basel und Zürich

*Gilbert Schintgen,* Mitglied
Managing Director, UBS Fund Management (Luxembourg) S.A., Luxemburg

*Christian Eibel,* Mitglied
Executive Director, UBS AG, Basel und Zürich

**Portfolio Manager**

*UBS (Lux) Bond Fund – AUD*
UBS Asset Management (Australia) Ltd., Sydney

*UBS (Lux) Bond Fund – Euro High Yield (EUR)*
UBS Asset Management (UK) Ltd., London

*UBS (Lux) Bond Fund – CHF*
*UBS (Lux) Bond Fund – Convert Europe (EUR)*
*UBS (Lux) Bond Fund – EUR*
*UBS (Lux) Bond Fund – GBP*
*UBS (Lux) Bond Fund – Global (CHF)*
*UBS (Lux) Bond Fund – USD*
UBS AG, UBS Asset Management,
Basel und Zürich

*UBS (Lux) Bond Fund – Full Cycle Asian Bond (USD)*
UBS Asset Management (Singapore) Ltd.,
Singapur

**Verwahrstelle und Hauptzahlstelle**

UBS (Luxembourg) S.A.,
33A, avenue J.F. Kennedy,
L-1855 Luxemburg

**Vertriebsstelle**

UBS AG, Basel und Zürich

**Administrationsstelle**

UBS Fund Services (Luxembourg) S.A.,
33A, avenue J.F. Kennedy,
L-1855 Luxemburg

**Réviseur d'entreprises agréé des Fonds und der Verwaltungsgesellschaft**

ERNST & YOUNG S.A.,
35E, avenue J.F. Kennedy,
L-1855 Luxemburg

**Vertrieb in der Schweiz**

*Vertreter*
UBS Fund Management (Switzerland) AG,
Aeschenplatz 6, CH-4052 Basel

*Zahlstellen*
UBS Switzerland AG, Bahnhofstrasse 45, CH-8001 Zürich
und ihre Geschäftsstellen in der Schweiz

Der Verkaufsprospekt, das KIID, die Vertragsbedingungen der Gesellschaft, Jahres- und Halbjahresberichte sowie die eingetretenen Änderungen im Wertpapierbestand der in dieser Publikation erwähnten Anlagefonds können kostenlos bei UBS Switzerland AG, Postfach, CH-8001 Zürich oder bei UBS Fund Management (Switzerland) AG, Postfach, CH-4002 Basel, angefordert werden.

## Vertrieb in Deutschland

*Zahl- und Informationsstelle*
UBS Deutschland AG,
Bockenheimer Landstrasse 2-4,
D-60306 Frankfurt am Main

Der Verkaufsprospekt, das KIID, die Vertragsbedingungen, Jahres- und Halbjahresberichte sowie die eingetretenen Änderungen im Wertpapierbestand des in dieser Publikation erwähnten Anlagefonds können kostenlos bei UBS Deutschland AG, Bockenheimer Landstr. 2-4, D-60306 Frankfurt am Main, angefordert werden.

## Vertrieb in Liechtenstein

*Zahlstelle und Vertreter*
Liechtensteinische Landesbank AG,
Städtle 44, FL-9490 Vaduz

## Vertrieb in Hongkong

Die Anteile der folgenden Subfonds sind nicht zum Vertrieb in Hongkong zugelassen:

*UBS (Lux) Bond Fund – AUD*
*UBS (Lux) Bond Fund – CHF*
*UBS (Lux) Bond Fund – Convert Europe (EUR)*
*UBS (Lux) Bond Fund – EUR*
*UBS (Lux) Bond Fund – GBP*
*UBS (Lux) Bond Fund – Global (CHF)*
*UBS (Lux) Bond Fund – USD*

## Vertrieb in Chile, in Dänemark, in Finnland, in Frankreich, in Griechenland, in Italien, in Japan, in Malta, in den Niederlanden, in Norwegen, in Österreich, in Portugal, in Schweden, in Singapur*, in Spanien, in Südkorea, in Taiwan, im Vereinigten Königreich und in Zypern

* Restricted foreign scheme

Anteile dieses Fonds können in diesen Ländern vertrieben werden.

Der Verkaufsprospekt, das KIID, die Vertragsbedingungen, Jahres- und Halbjahresberichte sowie die eingetretenen Änderungen im Wertpapierbestand des in dieser Publikation erwähnten Anlagefonds können kostenlos bei den Vertriebsstellen und am Sitz der Verwaltungsgesellschaft angefordert werden.

# Charakteristik des Fonds

UBS (Lux) Bond Fund (nachstehend als «Fonds» bezeichnet) offeriert dem Anleger verschiedene Subfonds («Umbrella Struktur»), die jeweils gemäss der im Verkaufsprospekt beschriebenen Anlagepolitik investieren. Die spezifischen Eigenschaften der einzelnen Subfonds sind im Verkaufsprospekt definiert, der bei jeder Auflegung eines neuen Subfonds aktualisiert wird.

Der Fonds wurde gemäss Teil I des luxemburgischen Gesetzes vom 30. März 1988 betreffend Organismen für gemeinsame Anlagen als ein rechtlich unselbstständiger offener Anlagefonds unter der Rechtsform eines Fonds Commun de Placement (FCP) aufgelegt und im April 2005 an die Anforderungen des luxemburgischen Gesetzes vom 20. Dezember 2002 betreffend Organismen für gemeinsame Anlagen angepasst. Seit dem 1. Juli 2011 untersteht der Fonds dem Gesetz von 2010. Er wurde ursprünglich unter dem Namen SBC Bond Portfolio gemäss den Vertragsbedingungen gegründet, die der Verwaltungsrat der UBS Bond Fund Management Company S.A. (ehemals SBC Bond Portfolio Management Company S.A.) am 26. Juni 1991 genehmigt hat. Der Name des SBC Bond Portfolio wurde am 1. April 1999 in UBS (Lux) Bond Fund umgewandelt. Die Tätigkeit der UBS Bond Fund Management Company S.A. in ihrer Funktion als Verwaltungsgesellschaft des UBS (Lux) Bond Fund endete am 14. November 2010. Am 15. November 2010 hat UBS Fund Management (Luxembourg) S.A. die Funktion der Verwaltungsgesellschaft übernommen. Die Vertragsbedingungen wurden erstmalig am 1. Juli 1991 beim Handels- und Gesellschaftsregister des Bezirksgerichts Luxemburg in Luxemburg hinterlegt, und Änderungen derselben wurden am 3. Oktober 2007, am 10. Dezember 2010, am 24. August 2011, am 27. August 2012 und zuletzt am 30. April 2015 mittels Hinterlegungsvermerk im Luxemburger «Mémorial» veröffentlicht.

Die Vertragsbedingungen des Fonds können unter Wahrung der rechtlichen Vorschriften geändert werden. Die Hinterlegung jeder Änderung wird im «Mémorial» publiziert. Die neuen Vertragsbedingungen treten am Tage der Unterzeichnung durch die Verwaltungsgesellschaft und die Verwahrstelle in Kraft. Die konsolidierte Fassung ist beim Handels- und Gesellschaftsregister des Bezirksgerichts Luxemburg zur Einsicht hinterlegt.

Der Fonds besitzt als Anlagefonds keine Rechtspersönlichkeit. Das gesamte Nettovermögen eines Subfonds steht in ungeteiltem Miteigentum aller, ihren Anteilen entsprechend gleichberechtigt beteiligten Anteilinhaber. Es ist vom Vermögen der Verwaltungsgesellschaft getrennt. Die Wertpapiere und sonstigen Vermögenswerte des Fonds werden als ein Sondervermögen von der Verwaltungsgesellschaft im Interesse und für Rechnung der Anteilinhaber verwaltet.

Die Vertragsbedingungen ermöglichen es der Verwaltungsgesellschaft, unterschiedliche Subfonds für den Fonds sowie verschiedene Anteilsklassen mit spezifischen Eigenschaften innerhalb dieser Subfonds zu gründen. Der Verkaufsprospekt wird jedes Mal bei der Auflegung eines neuen Subfonds bzw. einer zusätzlichen Anteilsklasse aktualisiert.

Zum 30. September 2016 sind folgende Subfonds aktiv:

| UBS (Lux) Bond Fund | Rechnungswährung der Subfonds |
|---|---|
| – AUD | AUD |
| – CHF | CHF |
| – Convert Europe (EUR) | EUR |
| – EUR | EUR |
| – Euro High Yield (EUR) | EUR |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) | USD |
| – GBP | GBP |
| – Global (CHF) | CHF |
| – USD | USD |

Nicht alle der nachfolgend beschriebenen Typen von Anteilsklassen müssen zu jeder Zeit angeboten werden. Informationen darüber, welche Anteilsklassen zur Verfügung stehen, sind bei der Administrationsstelle und unter www.ubs.com/funds erhältlich.

Die Anteile werden ausschliesslich als Namenanteile ausgegeben.

**«P»**

Anteile von Klassen mit Namensbestandteil «P» werden allen Anlegern angeboten. Sie weisen eine kleinste handelbare Einheit von 0.001. Sofern die Verwaltungsgesellschaft nichts anderes beschliesst, beträgt der Erstausgabepreis dieser Anteile AUD 100, CAD 100, CHF 100, CZK 2’000, EUR 100, GBP 100, HKD 1’000, JPY 10’000, PLN 500, RMB 1’000, RUB 3’500, SEK 700, SGD 100, USD 100 oder ZAR 1’000.

**«N»**

Anteile von Klassen mit Namensbestandteil «N» (= Anteile mit Einschränkungen der Vertriebspartner oder -länder) werden ausschliesslich über von der UBS AG dazu ermächtigte Vertriebsstellen mit Domizil Spanien, Italien, Portugal und Deutschland sowie ggf. in weiteren Vertriebsländern, sofern dies vom Verwaltungsrat beschlossen wird, ausgegeben. Sie weisen eine kleinste handelbare Einheit von 0.001 auf. Sofern die Verwaltungsgesellschaft nichts anderes beschliesst, beträgt der Erstausgabepreis dieser Anteile AUD 100, CAD 100, CHF 100, CZK 2'000, EUR 100, GBP 100, HKD 1'000, JPY 10'000, PLN 500, RMB 1'000, RUB 3'500, SEK 700, SGD 100, USD 100 oder ZAR 1'000.

**«K-1»**

Anteile von Klassen mit Namensbestandteil «K-1» werden allen Anlegern angeboten. Sie weisen eine kleinste handelbare Einheit von 0.1 auf. Sofern die Verwaltungsgesellschaft nichts anderes beschliesst, beträgt der Erstausgabepreis dieser Anteile AUD 5 Mio, CAD 5 Mio, CHF 5 Mio, CZK 100 Mio, EUR 3 Mio, GBP 2.5 Mio, HKD 40 Mio, JPY 500 Mio, PLN 25 Mio, RMB 35 Mio, RUB 175 Mio, SEK 35 Mio, SGD 5 Mio, USD 5 Mio oder ZAR 40 Mio.

**«K-X»**

Anteile von Klassen mit Namensbestandteil «K-X» werden ausschliesslich Anlegern angeboten, welche eine schriftliche Vereinbarung mit UBS AG, UBS Asset Management (ein Unternehmensbereich von UBS AG) zwecks Investition in einen oder mehrere Subfonds dieses Umbrellafonds unterzeichnet haben. Die Kosten für Vermögensverwaltung und Fondsadministration (bestehend aus Kosten der Verwaltungsgesellschaft, Administration und Verwahrstelle) sowie den Vertrieb werden dem Anleger im Rahmen der vorgenannten Vereinbarungen in Rechnung gestellt. Sie weisen eine kleinste handelbare Einheit von 0.001 auf. Sofern die Verwaltungsgesellschaft nichts anderes beschliesst, beträgt der Erstausgabepreis dieser Anteile AUD 100, CAD 100, CHF 100, CZK 2'000, EUR 100, GBP 100, HKD 1'000, JPY 10'000, PLN 500, RMB 1'000, RUB 3'500, SEK 700, SGD 100, USD 100 oder ZAR 1'000.

**«F»**

Anteile von Klassen mit Namensbestandteil «F» werden ausschliesslich der UBS AG oder einer ihrer Tochtergesellschaften angeboten. Die Anteile dürfen nur von der UBS AG oder einer ihrer Tochtergesellschaften auf eigene Rechnung oder im Rahmen von diskretionären Vermögensverwaltungsmandaten, die der UBS AG oder einer ihrer Tochtergesellschaften erteilt worden sind, erworben werden. Im letztgenannten Fall sind diese Anteile bei Auflösung des Vermögensverwaltungsmandats zum dann gültigen Nettoinventarwert spesenfrei dem Fonds zurückzugeben. Die Anteile weisen eine kleinste handelbare Einheit von 0.001 auf. Sofern die Verwaltungsgesellschaft nichts anderes beschliesst, beträgt der Erstausgabepreis dieser Anteile AUD 100, CAD 100, CHF 100, CZK 2'000, EUR 100, GBP 100, HKD 1'000, JPY 10'000, PLN 500, RMB 1'000, RUB 3'500, SEK 700, SGD 100, USD 100 oder ZAR 1'000.

**«Q»**

Anteile von Klassen mit Namensbestandteil «Q» sind verfügbar:

i) für den Vertrieb in einem gemäss «Liste A» zulässigen Land; oder

ii) für in anderen Ländern ansässige Anleger, sofern es sich dabei um professionelle Anleger handelt und eine schriftliche Vereinbarung mit UBS AG besteht, welche die folgenden Anlagen in eigenem Namen tätigen und:
   (a) auf eigene Rechnung;
   (b) auf Rechnung der unterliegenden Kunden im Rahmen eines Vermögensverwaltungsvertrages;
   (c) auf Rechnung der unterliegenden Kunden im Rahmen eines schriftlich abgeschlossenen, entgeltlichen Beratungsverhältnisses; oder
   (d) für eine kollektive Kapitalanlage, die von einer im Finanzsektor professionell tätigen Person verwaltet wird.

In den Fällen (b), (c) und (d) wurde diese im Finanzsektor professionell tätige Person von der Aufsichtsbehörde, der sie untersteht, ordnungsgemäss zur Durchführung solcher Geschäfte autorisiert. Ferner ist diese Person ansässig in einem gemäss «Liste B» zulässigen Land oder handelt im eigenen Namen und auf Rechnung einer anderen im Finanzsektor professionell tätigen Person handelt, die über eine schriftliche Autorisierung der UBS AG verfügt und im Falle von (b) in einem auf der «Liste B», respektive im Falle von (c) in einem auf der «Liste C» aufgeführten Länder ansässig ist.

Über die Zulassung von Anlegern in weiteren Vertriebsländern (Veränderungen der Listen A, B und C) entscheidet der Verwaltungsrat nach eigenem Ermessen. Die entsprechenden Informationen werden veröffentlicht auf www.ubs.com/funds.

Die Anteile weisen eine kleinste handelbare Einheit von 0.001 auf. Sofern die Verwaltungsgesellschaft nichts anderes beschliesst, beträgt der Erstausgabepreis dieser Anteile AUD 100, CAD 100, CHF 100, CZK 2'000, EUR 100, GBP 100, HKD 1'000, JPY 10'000, PLN 500, RMB 1'000, RUB 3'500, SEK 700, SGD 100, USD 100 oder ZAR 1'000.

**«I-A1»**

Anteile von Klassen mit dem Namensbestandteil «I-A1» werden ausschliesslich institutionellen Anlegern i.S.d. Art. 174 (2) Buchst. c) des geänderten Gesetzes von 2010 angeboten. Sie weisen eine kleinste handelbare Einheit von 0.001 auf. Sofern die Verwaltungsgesellschaft nichts anderes beschliesst, beträgt der Erstausgabepreis dieser Anteile AUD 100, CAD 100, CHF 100, CZK 2'000, EUR 100, GBP 100, HKD 1'000, JPY 10'000, PLN 500, RMB 1'000, RUB 3'500, SEK 700, SGD 100, USD 100 oder ZAR 1'000.

**«I-A2»**

Anteile von Klassen mit Namensbestandteil «I-A2» werden ausschliesslich institutionellen Anlegern i.S.d. Art. 174 (2) Buchst. c) des geänderten Gesetzes von 2010 angeboten. Sie weisen eine kleinste handelbare Einheit von 0.001 auf. Sofern die Verwaltungsgesellschaft nichts anderes beschliesst, beträgt der Erstausgabepreis dieser Anteile AUD 100, CAD 100, CHF 100, CZK 2'000, EUR 100, GBP 100, HKD 1'000, JPY 10'000, PLN 500, RMB 1'000, RUB 3'500, SEK 700, SGD 100, USD 100 oder ZAR 1'000. Der Mindestzeichnungsbetrag für diese Anteile beträgt AUD 10 Mio, CAD 10 Mio, CHF 10 Mio, CZK 200 Mio, EUR 5 Mio, GBP 5 Mio, HKD 80 Mio, JPY 1 Mia, PLN 50 Mio, RMB 70 Mio, RUB 350 Mio, SEK 70 Mio, SGD 10 Mio, USD 10 Mio oder ZAR 80 Mio.

Bei der Zeichnung muss
(i) eine Mindestzeichnung gemäss der vorgenannten Auflistung erfolgen;
(ii) gestützt auf eine schriftliche Vereinbarung des institutionellen Anlegers mit der UBS AG – bzw. mit einem von dieser ermächtigten Vertragspartner – sein bei UBS verwaltetes Gesamtvermögen oder sein Bestand in kollektiven Kapitalanlagen der UBS mehr als CHF 30 Mio (oder das entsprechende Währungsäquivalent) betragen oder;
(iii) der institutionelle Anleger eine Einrichtung zur beruflichen Vorsorge der UBS Group AG oder eine ihrer 100 prozentigen Konzerngesellschaften sein.

**«I-A3»**

Anteile von Klassen mit Namensbestandteil «I-A3» werden ausschliesslich institutionellen Anlegern i.S.d. Art. 174 (2) Buchst. c) des geänderten Gesetzes von 2010 angeboten. Sie weisen eine kleinste handelbare Einheit von 0.001 auf. Sofern die Verwaltungsgesellschaft nichts anderes beschliesst, beträgt der Erstausgabepreis dieser Anteile AUD 100, CAD 100, CHF 100, CZK 2'000, EUR 100, GBP 100, HKD 1'000, JPY 10'000, PLN 500, RMB 1'000, RUB 3'500, SEK 700, SGD 100, USD 100 oder ZAR 1'000. Der Mindestzeichnungsbetrag für diese Anteile beträgt AUD 30 Mio, CAD 30 Mio, CHF 30 Mio, CZK 600 Mio, EUR 20 Mio, GBP 20 Mio, HKD 240 Mio, JPY 3 Mia, PLN 150 Mio, RMB 210 Mio, RUB 1.05 Mia, SEK 210 Mio, SGD 30 Mio, USD 30 Mio oder ZAR 240 Mio.

Bei der Zeichnung muss
(i) eine Mindestzeichnung gemäss der vorgenannten Auflistung erfolgen;
(ii) gestützt auf eine schriftliche Vereinbarung des institutionellen Anlegers mit der UBS AG – bzw. einem von dieser ermächtigten Vertragspartner – sein bei UBS verwaltetes Gesamtvermögen oder sein Bestand in kollektiven Kapitalanlagen der UBS mehr als CHF 100'000'000 (oder das entsprechende Währungsäquivalent) betragen oder;
(iii) der institutionelle Anleger eine Einrichtung zur beruflichen Vorsorge der UBS Group AG oder eine ihrer 100 prozentigen Konzerngesellschaften sein.

**«I-B»**

Anteile von Klassen mit Namensbestandteil «I-B» werden ausschliesslich institutionellen Anlegern i.S.d. Art. 174 (2) Buchst. c) des geänderten Gesetzes von 2010 angeboten, welche eine schriftliche Vereinbarung mit UBS AG bzw. einem von dieser ermächtigten Vertragspartner zwecks Investition in einen oder mehrere Subfonds dieses Umbrellafonds unterzeichnet haben. Die Kosten für die Fondsadministration (bestehend aus Kosten der Verwaltungsgesellschaft, Administration und Verwahrstelle) werden mittels Kommission direkt dem Subfonds belastet. Die Kosten für die Vermögensverwaltung und den Vertrieb werden dem Anleger im Rahmen der vorgenannten Vereinbarungen in Rechnung gestellt. Sie weisen eine kleinste handelbare Einheit von 0.001 auf. Sofern die Verwaltungsgesellschaft nichts anderes beschliesst, beträgt der Erstausgabepreis dieser Anteile AUD 100, CAD 100, CHF 100, CZK 2'000, EUR 100, GBP 100, HKD 1'000, JPY 10'000, PLN 500, RMB 1'000, RUB 3'500, SEK 700, SGD 100, USD 100 oder ZAR 1'000.

**«I-X»**

Anteile von Klassen mit Namensbestandteil «I-X» werden ausschliesslich institutionellen Anlegern i.S.d. Art. 174 (2) Buchst. c) des geänderten Gesetzes von 2010 angeboten, welche eine schriftliche Vereinbarung mit UBS AG bzw. einem von dieser ermächtigten Vertragspartner zwecks Investition in einen oder mehrere Subfonds dieses Umbrellafonds unterzeichnet haben. Die Kosten für Vermögensverwaltung und Fondsadministration (bestehend aus Kosten der Verwaltungsgesellschaft, Administration und Verwahrstelle) sowie den Vertrieb werden dem Anleger im Rahmen der vorgenannten Vereinbarungen in Rechnung gestellt. Sie weisen eine kleinste handelbare Einheit von 0.001 auf. Sofern die Verwaltungsgesellschaft nichts anderes beschliesst, beträgt der Erstausgabepreis dieser Anteile AUD 100, CAD 100, CHF 100, CZK 2'000, EUR 100, GBP 100, HKD 1'000, JPY 10'000, PLN 500, RMB 1'000, RUB 3'500, SEK 700, SGD 100, USD 100 oder ZAR 1'000.

**«U-X»**

Anteile von Klassen mit Namensbestandteil «U-X» werden ausschliesslich institutionellen Anlegern i.S.d. Art. 174 (2) Buchst. c) des geänderten Gesetzes von 2010 angeboten, welche eine schriftliche Vereinbarung mit UBS AG bzw. einem von dieser ermächtigten Vertragspartner zwecks Investition in einen oder mehrere Subfonds dieses Umbrellafonds unterzeichnet haben. Die Kosten für Vermögensverwaltung und Fondsadministration (bestehend aus Kosten der Verwaltungsgesellschaft, Administration und Verwahrstelle) sowie den Vertrieb werden dem Anleger im Rahmen der vorgenannten Vereinbarungen in Rechnung gestellt. Diese Anteilsklasse ist ausschliesslich auf Finanzprodukte ausgerichtet (d.h. Dachfonds oder sonstige gepoolte Strukturen gemäss unterschiedlichen Gesetzgebungen). Sie weisen eine kleinste handelbare Einheit von 0.001 auf. Sofern die Verwaltungsgesellschaft nichts anderes beschliesst,

beträgt der Erstausgabepreis dieser Anteile AUD 10'000, CAD 10'000, CHF 10'000, CZK 200'000, EUR 10'000, GBP 10'000, HKD 100'000, JPY 1 Mio, PLN 50'000, RMB 100'000, RUB 350'000, SEK 70'000, SGD 10'000, USD 10'000 oder ZAR 100'000.

Zusätzliche Merkmale:

**«UKdist»**

Die vorgenannten Anteilsklassen können als solche mit dem Namensbestandteil «UKdist» ausgegeben werden. In diesen Fällen beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft die Ausschüttung eines Betrages, welcher 100% der meldepflichtigen Erträge im Sinne der im Vereinigten Königreich («UK») geltenden Bestimmungen für «Reporting Funds» entspricht, wenn die Anteilsklassen den Bestimmungen für «Reporting Funds» unterliegen. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt nicht, in Bezug auf diese Anteilsklassen Steuerwerte in anderen Ländern zur Verfügung zu stellen, da sich diese Anteilsklassen an Anleger richten, die im Vereinigten Königreich mit ihrer Anlage in der Anteilsklasse steuerpflichtig sind.

**Währungen**

Die Anteilsklassen können auf die Währungen AUD, CAD, CHF, CZK, EUR, GBP, HKD, JPY, PLN, RMB, RUB, SEK, SGD, USD oder ZAR lauten. Für Anteilsklassen die in der Rechnungswährung der jeweiligen Subfonds ausgegeben werden, wird die jeweilige Währung nicht als Namensbestandteil der Anteilsklasse aufgeführt. Die Rechnungswährung geht aus dem Namen des jeweiligen Subfonds hervor.

**«hedged»**

Bei Anteilsklassen, deren Referenzwährungen nicht der Rechnungswährung des Subfonds entsprechen und die den Namensbestandteil «hedged» enthalten («Anteilsklassen in Fremdwährung»), wird das Schwankungsrisiko des Kurses der Referenzwährung jener Anteilsklassen gegenüber der Rechnungswährung des Subfonds abgesichert. Es ist vorgesehen, dass diese Absicherung grundsätzlich zwischen 90% und 110% des gesamten Nettovermögens der Anteilsklasse in Fremdwährung beträgt. Änderungen des Marktwerts des Portfolios sowie Zeichnungen und Rücknahmen bei Anteilsklassen in Fremdwährung können dazu führen, dass die Absicherung zeitweise ausserhalb des vorgenannten Umfangs liegt.

Die beschriebene Absicherung wirkt sich nicht auf mögliche Währungsrisiken aus, die aus Investitionen resultieren, die in anderen Währungen als der Rechnungswährung des jeweiligen Subfonds notieren.

**«DH»**

Bei Anteilsklassen mit dem Namensbestandteil «DH» (Duration hedged) werden derivative Instrumente (z.B. börsengehandelte Terminkontrakte auf Zinsen oder OTC-Zinssatztauschgeschäfte) gehalten, um die Duration des Nettoinventarwerts der DH-Anteilsklasse zu reduzieren, wobei der Wert von Null nicht unterschritten wird. Dafür werden diese Positionen und damit zusammenhängende Gewinne oder Verluste ausschliesslich für die Berechnung des Nettoinventarwerts der DH-Anteilsklassen berücksichtigt. Duration ist ein Instrument zur Messung der Preiselastizität von Obligationen im Hinblick auf Zinssatzänderungen. Je höher die Duration eines Obligationenportfolios, desto stärker reagiert dessen Marktwert auf Änderungen von Zinsen; je niedriger die Duration eines Obligationenportfolios, desto weniger stark reagiert dessen Marktwert auf Änderungen von Zinsen. Die Duration des Nettoinventarwerts der DH-Anteilsklasse wird nicht höher sein als diejenige von Anteilsklassen, die den Namensbestandteil «DH» nicht aufweisen. Deshalb wird der Nettoinventarwert der DH-Anteilsklasse gleich oder weniger stark auf Änderungen der Zinsen reagieren als der Nettoinventarwert von Anteilsklassen, die den Namensbestandteil «DH» nicht aufweisen.

In den «DH» Anteilsklassen für den Subfonds «UBS (Lux) Bond Fund – Full Cycle Asian Bond (USD)» wird lediglich der Teil des Portfolios welcher in USD-Wertschriften angelegt ist, wie beschrieben abgesichert. Somit verbleiben auch für die mit «DH» bezeichneten Anteilsklassen die Zinsrisiken aller nicht in USD-Wertschriften angelegten Teile des Portfolios. Da der Teil des Portfolios, welcher in USD-Wertschriften angelegt ist, über die Zeit schwanken kann, kann dies unter Umständen dazu führen, dass die gesamte Duration der mit DH bezeichneten Klassen nicht tiefer ist als die Duration des Subfonds.

**«RMB hedged»**

Anleger sollten beachten, dass der Renminbi (Währungscode gemäss ISO 4217: CNY), die offizielle Währung der Volksrepublik China (die «VRC»), an zwei Märkten gehandelt wird: Auf dem chinesischen Festland als Onshore RMB (CNY) und ausserhalb des chinesischen Festlands als Offshore RMB (CNH).

Der Nettoinventarwert von Anteilen der Klassen, die die Bezeichnung «RMB hedged» in ihrem Namen tragen, wird in Offshore RMB (CNH) berechnet.

Beim Onshore RMB (CNY) handelt es sich um eine nicht frei konvertierbare Währung; er unterliegt Devisenkontrollbestimmungen und Beschränkungen in Bezug auf die Repatriierung, die von der Regierung der VRC festgelegt werden. Der Offshore RMB (CNH) kann hingegen gegen andere Währungen, insbesondere EUR, CHF und USD, frei gewechselt werden. Dies bedeutet, dass der Wechselkurs zwischen dem Offshore RMB (CNH) und anderen Währungen durch Angebot und Nachfrage für das jeweilige Währungspaar bestimmt wird.

Der Wechsel von Offshore RMB (CNH) in Onshore RMB (CNY) und umgekehrt ist ein geregelter Währungsprozess, der Devisenkontrollbestimmungen und

Repatriierungsbeschränkungen unterliegt, die von der Regierung der VRC zusammen mit externen Aufsichts- oder Regierungsbehörden (z. B. der Hong Kong Monetary Authority) festgelegt werden.

Vor der Anlage in RMB-Klassen sollten die Anleger beachten, dass es keine klaren Regelungen bezüglich der aufsichtsrechtlichen Berichterstattung und Fondsrechnungslegung für den Offshore RMB (CNH) gibt. Des Weiteren ist zu bedenken, dass Offshore RMB (CNH) und Onshore RMB (CNY) unterschiedliche Wechselkurse gegenüber anderen Währungen haben. Der Wert des Offshore RMB (CNH) unterscheidet sich unter Umständen stark von dem des Onshore RMB (CNY) aufgrund einiger Faktoren, darunter Devisenkontrollbestimmungen und Repatriierungsbeschränkungen, die von der Regierung der VRC zu gegebener Zeit festgelegt werden, sowie sonstiger externer Marktfaktoren. Eine Abwertung des Offshore RMB (CNH) könnte sich negativ auf den Wert der Anlegerinvestitionen in den RMB-Klassen auswirken. Die Anleger sollten somit bei der Umrechnung ihrer Investitionen und der damit verbundenen Erträge aus dem Offshore RMB (CNH) in ihre Zielwährung diese Faktoren berücksichtigen.

Vor der Anlage in RMB-Klassen sollten Anleger ferner darauf achten, dass die Verfügbarkeit und Marktfähigkeit von RMB-Klassen sowie die Bedingungen, zu denen diese verfügbar gemacht oder gehandelt werden, zu einem grossen Teil von den politischen und aufsichtsrechtlichen Entwicklungen in der VRC abhängig sind. Somit kann keine Zusicherung dahingehend abgegeben werden, dass der Offshore RMB (CNH) oder die RMB-Klassen künftig angeboten und/oder gehandelt werden bzw. zu welchen Bedingungen der Offshore RMB (CNH) und/oder die RMB-Klassen verfügbar sein oder gehandelt werden. Da es sich bei der Rechnungswährung der Subfonds, die RMB-Klassen anbieten, um eine andere Währung als Offshore RMB (CNH) handeln würde, wäre die Fähigkeit des betreffenden Subfonds, Rückerstattungen in Offshore RMB (CNH) zu machen, von der Fähigkeit des Subfonds zum Wechsel seiner Rechnungswährung in Offshore RMB (CNH) abhängig, die wiederum durch die Verfügbarkeit von Offshore RMB (CNH) oder sonstigen von der Verwaltungsgesellschaft nicht beeinflussbaren Bedingungen beschränkt sein könnte.

Potenzielle Anleger sollten sich der Risiken einer erneuten Anlage bewusst sein, die sich ergeben könnte, wenn die RMB-Klasse aufgrund politischer und/oder aufsichtsrechtlicher Gegebenheiten vorzeitig aufgelöst werden muss. Dies gilt nicht für das mit einer erneuten Anlage verbundene Risiko aufgrund der Auflösung einer Anteilsklasse und/oder des Subfonds gemäss Abschnitt «Auflösung und Zusammenlegung des Fonds und seiner Subfonds bzw. Anteilsklassen, Verschmelzung von Subfonds» des Verkaufsprospektes.

**«acc»**

Bei Anteilsklassen mit dem Namensbestandteil «-acc» werden keine Erträge ausgeschüttet, sofern die Verwaltungsgesellschaft nichts anderes beschliesst.

**«dist»**

Bei Anteilsklassen mit dem Namensbestandteil «-dist» werden Erträge ausgeschüttet, sofern die Verwaltungsgesellschaft nichts anderes beschliesst.

**«qdist»**

Anteile von Klassen mit dem Namensbestandteil «-qdist» können vierteljährliche Ausschüttungen exklusive Gebühren und Auslagen vornehmen. Ausschüttungen können auch aus dem Kapital (dies kann unter anderem realisierte und unrealisierte Nettoveränderungen im Nettoinventarwert beinhalten) (**«Kapital»**) erfolgen. Die Ausschüttung aus Kapital hat zur Folge, dass das durch den Anleger in den Subfonds investierte Kapital dadurch abnimmt. Ausserdem führen etwaige Ausschüttungen aus Erträgen und/oder dem Kapital zu einer sofortigen Senkung des Nettoinventarwertes pro Anteil des Subfonds. Für Investoren in gewissen Ländern können auf ausgeschüttetem Kapital höhere Steuersätze zur Anwendung kommen als auf Kapitalgewinnen, welche bei der Veräusserung von Fondsanteilen realisiert werden. Gewisse Investoren könnten deshalb bevorzugen, in reinvestierende (-acc) Anteilsklassen statt in ausschüttende (-dist, -qdist) Anteilsklassen zu investieren. Investoren können auf Erträgen und Kapital aus reinvestierenden (-acc) Anteilsklassen zu einem späteren Zeitpunkt besteuert werden als bei ausschüttenden (-dist). Anlegern wird geraten, diesbezüglich ihren Steuerberater zu konsultieren.

**«mdist»**

Anteile von Klassen mit dem Namensbestandteil «-mdist» können monatliche Ausschüttungen exklusive Gebühren und Auslagen vornehmen. Ausschüttungen können auch aus dem Kapital erfolgen. Die Ausschüttung aus Kapital hat zur Folge, dass das durch den Anleger in den Subfonds investierte Kapital dadurch abnimmt. Ausserdem führen etwaige Ausschüttungen aus Erträgen und/oder dem Kapital zu einer sofortigen Senkung des Nettoinventarwertes pro Anteil des Subfonds. Für Investoren in gewissen Ländern können auf ausgeschüttetem Kapital höhere Steuersätze zur Anwendung kommen als auf Kapitalgewinnen, welche bei der Veräusserung von Fondsanteilen realisiert werden. Gewisse Investoren könnten deshalb bevorzugen, in reinvestierende (-acc) Anteilsklassen statt in ausschüttende (-dist, -mdist) Anteilsklassen zu investieren. Investoren können auf Erträgen und Kapital aus reinvestierenden (-acc) Anteilsklassen zu einem späteren Zeitpunkt besteuert werden als bei ausschüttenden (-dist). Anlegern wird geraten, diesbezüglich ihren Steuerberater zu konsultieren. Die maximale Ausgabekommission für Anteile von Klassen mit dem Namensbestandteil «-mdist» beträgt 6%.

**«2%», «4%», «6%», «8%»**

Anteile von Klassen mit dem Namensbestandteil «2%» / «4%» / «6%» / «8%» können monatliche (-mdist), vierteljährliche (-qdist) oder jährliche (-dist) Ausschüttungen in der jeweiligen, zuvorgenannten, jährlichen prozentualen Rate vor Abzug von Gebühren und Auslagen vornehmen. Die Berechnung der Ausschüttung basiert auf dem Nettoinventarwert der entsprechenden Anteilsklasse des Monatsendes (bei monatlichen Ausschüttungen), Geschäftsquartalsendes (bei vierteljährlichen Ausschüttungen) oder Geschäftsjahresendes (bei jährlichen Ausschüttungen). Diese Anteilsklassen eignen sich für Investoren, welche stabilere Ausschüttungen wünschen, unabhängig vom erzielten oder erwarteten Wertzuwachs oder Ertrag des entsprechenden Subfonds.

Ausschüttungen können entsprechend auch aus dem Kapital erfolgen. Die Ausschüttung aus Kapital hat zur Folge, dass das durch den Anleger in den Subfonds investierte Kapital dadurch abnimmt. Ausserdem führen etwaige Ausschüttungen aus Erträgen und/oder dem Kapital zu einer sofortigen Senkung des Nettoinventarwertes pro Anteil des Subfonds. Für Investoren in gewissen Ländern können auf ausgeschüttetem Kapital höhere Steuersätze zur Anwendung kommen als auf Kapitalgewinnen, welche bei der Veräusserung von Fondsanteilen realisiert werden. Gewisse Investoren könnten deshalb bevorzugen, in reinvestierende (-acc) Anteilsklassen statt in ausschüttende (-dist, -qdist, -mdist) Anteilsklassen zu investieren. Investoren können auf Erträgen und Kapital aus reinvestierenden (-acc) Anteilsklassen zu einem späteren Zeitpunkt besteuert werden als bei ausschüttenden (-dist, -qdist, -mdist). Anlegern wird geraten, diesbezüglich ihren Steuerberater zu konsultieren.

Das Nettovermögen, die Anzahl der Anteile, die Anzahl der Subfonds und der Anteilsklassen sowie die Laufzeit des Fonds und seiner Subfonds sind nicht begrenzt.

Der Fonds bildet eine rechtliche Einheit. Im Verhältnis der Anteilinhaber unter sich wird jedoch jeder Subfonds als getrennt angesehen. Die Vermögenswerte eines Subfonds haften nur für solche Verbindlichkeiten, die von dem betreffenden Subfonds eingegangen werden.

Mit dem Erwerb der Anteile erkennt der Inhaber alle Bestimmungen der Vertragsbedingungen an.

Die Vertragsbedingungen sehen keine Generalversammlung der Anteilinhaber vor.

Das Geschäftsjahr des Fonds endet am letzten Tag des Monats März.

Der Ausgabe- und Rücknahmepreis jedes Subfonds wird in Luxemburg am Sitz der Verwaltungsgesellschaft und der Verwahrstelle bekannt gegeben.

Des Weiteren wird Anlegern vor der Zeichnung von Anteilen ein Dokument mit den wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) zur Verfügung gestellt.

Informationen darüber, ob ein Subfonds des Fonds an der Börse von Luxemburg notiert ist, sind bei der Administrationsstelle oder auf der Internet-Seite der Börse von Luxemburg (www.bourse.lu) erhältlich.

Bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen des Fonds kommen die im jeweiligen Land geltenden Bestimmungen zur Anwendung.

Gültigkeit haben nur die Informationen, die im Verkaufsprospekt und in einem der im Verkaufsprospekt aufgeführten Dokumente enthalten sind.

Die Jahres- und Halbjahresberichte stehen den Anteilinhabern kostenlos am Sitz der Verwaltungsgesellschaft und der Verwahrstelle zur Verfügung.

Keine Zeichnung darf auf der Grundlage der Geschäftsberichte entgegengenommen werden. Die Zeichnungen erfolgen nur auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospektes, dem der letzte Jahresbericht und der letzte Halbjahresbericht beigefügt ist.

Die Zahlen in diesem Bericht sind historisch und nicht notwendigerweise indikativ für zukünftige Ergebnisse.

## Konsolidierte Nettovermögensaufstellung

| | | EUR |
|---|---|---|
| **Aktiva** | | **30.9.2016** |
| Wertpapierbestand, Einstandswert | 5 600 945 766.72 | |
| Wertpapierbestand, nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) | 109 232 011.36 | |
| Total Wertpapierbestand (Erläuterung 1) | | 5 710 177 778.08 |
| Bankguthaben, Sicht- und Fristgelder | | 201 068 006.04* |
| Festgelder und Treuhandanlagen | | 7 783 110.93 |
| Andere liquide Mittel (Margins) | | 4 096 326.45 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen (Erläuterung 1) | | 32 954 834.19 |
| Forderungen aus Zeichnungen | | 19 252 575.06 |
| Zinsforderungen aus Wertpapieren | | 75 166 088.75 |
| Zinsforderungen aus liquiden Mitteln | | 15 766.50 |
| Nicht realisierter Kursgewinn (-verlust) aus TBA Mortgage Backed Securities (Erläuterung 1) | | 21 783.46 |
| Nicht realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten (Erläuterung 1) | | -317 166.03 |
| Nicht realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Devisenterminkontrakten (Erläuterung 1) | | 11 421 571.30 |
| Nicht realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Swaps (Erläuterung 1) | | -1 249 382.70 |
| **Total Aktiva** | | **6 060 391 292.03** |
| | | |
| **Passiva** | | |
| Kontokorrentkredit | | -780 097.77 |
| Zinsverbindlichkeiten aus Kontokorrentkredit | | -47 859.81 |
| Verbindlichkeiten aus Swaps | | -17 623.74 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen (Erläuterung 1) | | -63 159 133.22 |
| Verbindlichkeiten aus Rücknahmen | | -29 040 304.84 |
| Andere Verbindlichkeiten | | -16 284.00 |
| Rückstellungen für pauschale Verwaltungskommission (Erläuterung 2) | -2 292 214.65 | |
| Rückstellungen für Abonnementsabgabe (Erläuterung 3) | -621 280.71 | |
| Rückstellungen für sonstige Kommissionen und Gebühren (Erläuterung 2) | -79 474.49 | |
| Total Rückstellungen für Aufwendungen | | -2 992 969.85 |
| **Total Passiva** | | **-96 054 273.23** |
| | | |
| **Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode** | | **5 964 337 018.80** |

* Zum 30. September 2016 wurden gegenüber JP Morgan Chase London Bankguthaben in Höhe von EUR 1 700 000 und Merill Lynch Bankguthaben in Höhe von EUR 700 000 als Sicherheit eingesetzt.

## Konsolidierte Ertrags- und Aufwandsrechnung

| | EUR |
|---|---|
| **Erträge** | **1.4.2016-30.9.2016** |
| Zinsertrag auf liquide Mittel | 98 720.36 |
| Zinsen auf Wertpapiere | 133 913 801.94 |
| Dividenden | 240 856.78 |
| Erträge aus Securities Lending (Erläuterung 11) | 626 479.97 |
| Sonstige Erträge | 3 331 219.61 |
| **Total Erträge** | **138 211 078.66** |
| | |
| **Aufwendungen** | |
| Kosten aus Securities Lending (Erläuterung 11) | -250 591.98 |
| Pauschale Verwaltungskommission (Erläuterung 2) | -30 616 093.07 |
| Abonnementsabgabe (Erläuterung 3) | -1 302 894.24 |
| Sonstige Kommissionen und Gebühren (Erläuterung 2) | -348 949.87 |
| Zinsaufwand auf liquide Mittel und Kontokorrentkredit | -159 045.88 |
| Sonstige Aufwendungen | -42 720.94 |
| **Total Aufwendungen** | **-32 720 295.98** |
| | |
| **Nettoerträge (-verluste) aus Anlagen** | **105 490 782.68** |
| | |
| **Realisierte Gewinne (Verluste) (Erläuterung 1)** | |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus marktbewerteten Wertpapieren ausser Optionen | 11 856 674.46 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Optionen | -2 578 151.80 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus renditebewerteten Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten | -217 245.52 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten | -675 591.70 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Devisenterminkontrakten | 1 315 924.60 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Swaps | -24 377 899.96 |
| Realisierter Währungsgewinn (-verlust) | 24 083 083.34 |
| **Total der realisierten Gewinne (Verluste)** | **9 406 793.42** |
| | |
| **Realisierter Nettogewinn (-verlust) der Berichtsperiode** | **114 897 576.10** |
| | |
| **Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung) (Erläuterung 1)** | |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) marktbewerteter Wertpapiere ausser Optionen | 157 973 404.25 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) renditebewerteter Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | -585 681.09 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) von Optionen | -56 059.80 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) von TBA Mortgage Backed Securities | 6 375.06 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) von Finanzterminkontrakten | 83 372.60 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) von Devisenterminkontrakten | 31 116 593.65 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) von Swaps | 20 920 293.56 |
| **Total der Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung)** | **209 458 298.23** |
| | |
| **Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens infolge Geschäftstätigkeit** | **324 355 874.33** |

# UBS (Lux) Bond Fund – AUD

## Wichtigste Daten

| | ISIN | 30.9.2016 | 31.3.2016 | 31.3.2015 |
|---|---|---|---|---|
| Nettovermögen in AUD | | 324 435 551.13 | 344 153 838.38 | 387 753 845.70 |
| **Klasse F-acc** | **LU0415157832** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 5 375.0000 | 6 245.0000 | 11 860.0000 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in AUD | | 508.90 | 489.31 | 480.11 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in AUD[1] | | 508.90 | 489.31 | 480.11 |
| **Klasse I-A1-acc[2]** | **LU0415158210** | | | |
| Anteile im Umlauf | | - | 3 094.0000 | 3 400.0000 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in AUD | | - | 114.76 | 112.74 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in AUD[1] | | - | 114.76 | 112.74 |
| **Klasse I-X-acc[3]** | **LU0415159374** | | | |
| Anteile im Umlauf | | - | 5 115.3280 | 3 304.6670 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in AUD | | - | 103.12 | 100.83 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in AUD[1] | | - | 103.12 | 100.83 |
| **Klasse N-acc** | **LU0415156602** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 16 603.1510 | 13 335.7000 | 9 192.4730 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in AUD | | 118.99 | 114.81 | 113.45 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in AUD[1] | | 118.99 | 114.81 | 113.45 |
| **Klasse P-acc** | **LU0035338325** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 393 265.7500 | 448 944.9690 | 484 270.4250 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in AUD | | 499.11 | 481.36 | 475.17 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in AUD[1] | | 499.11 | 481.36 | 475.17 |
| **Klasse P-dist** | **LU0035338242** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 894 584.5410 | 931 489.7270 | 1 161 826.8010 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in AUD | | 119.47 | 119.33 | 122.68 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in AUD[1] | | 119.47 | 119.33 | 122.68 |
| **Klasse Q-acc** | **LU0415158053** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 92 247.5560 | 61 422.4220 | 68 343.1750 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in AUD | | 118.42 | 113.98 | 112.06 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in AUD[1] | | 118.42 | 113.98 | 112.06 |
| **Klasse Q-dist[4]** | **LU0415157915** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 53 737.9390 | 43 300.1640 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in AUD | | 104.90 | 102.15 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in AUD[1] | | 104.90 | 102.15 | - |

[1] Siehe Erläuterung 1
[2] Die Anteilsklasse I-A1-acc war bis zum 18.4.2016 im Umlauf
[3] Die Anteilsklasse I-X-acc war bis zum 16.9.2016 im Umlauf
[4] Für die Periode vom 3.2.2014 bis zum 23.2.2015 war die Anteilsklasse Q-dist im Umlauf - reaktiviert 3.12.2015

## Struktur des Wertpapierbestandes

| Geographische Aufteilung in % des Nettovermögens | |
|---|---|
| Australien | 71.29 |
| Deutschland | 8.21 |
| Supranational | 7.70 |
| Vereinigte Staaten | 4.31 |
| Kanada | 1.18 |
| Grossbritannien | 0.96 |
| Frankreich | 0.90 |
| Norwegen | 0.50 |
| Neuseeland | 0.49 |
| **Total** | **95.54** |

| Wirtschaftliche Aufteilung in % des Nettovermögens | |
|---|---|
| Länder- & Zentralregierungen | 23.24 |
| Banken & Kreditinstitute | 17.98 |
| Öffentlich-rechtliche Körperschaften | 11.18 |
| Finanz- & Beteiligungsgesellschaften | 9.45 |
| Kantone, Bundesstaaten | 8.41 |
| Supranationale Organisationen | 7.70 |
| Pfandbriefinstitute & Refinanzierungsgesellschaften | 3.83 |
| Diverse nicht klassierte Gesellschaften | 2.94 |
| Verkehr & Transport | 2.88 |
| Energie- & Wasserversorgung | 1.85 |
| Versicherungen | 1.53 |
| Gesundheits- & Sozialwesen | 1.08 |
| Computer & Netzwerkausrüster | 1.03 |
| Flugzeug- & Raumfahrtindustrie | 0.98 |
| Elektrische Geräte & Komponenten | 0.63 |
| Diverse Konsumgüter | 0.49 |
| Erdöl | 0.34 |
| **Total** | **95.54** |

## Nettovermögensaufstellung

| | | AUD |
|---|---|---|
| **Aktiva** | | **30.9.2016** |
| Wertpapierbestand, Einstandswert | 296 262 581.98 | |
| Wertpapierbestand, nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) | 13 700 678.36 | |
| Total Wertpapierbestand (Erläuterung 1) | | 309 963 260.34 |
| Festgelder und Treuhandanlagen | | 11 429 807.34 |
| Andere liquide Mittel (Margins) | | 132 501.80 |
| Forderungen aus Zeichnungen | | 4 676 561.66 |
| Zinsforderungen aus Wertpapieren | | 3 438 759.53 |
| Zinsforderungen aus liquiden Mitteln | | 154.92 |
| Nicht realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten (Erläuterung 1) | | 119 469.45 |
| **Total Aktiva** | | **329 760 515.04** |
| | | |
| **Passiva** | | |
| Kontokorrentkredit | | -1 306.60 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen (Erläuterung 1) | | -4 947 818.79 |
| Verbindlichkeiten aus Rücknahmen | | -216 642.63 |
| Rückstellungen für pauschale Verwaltungskommission (Erläuterung 2) | -115 032.92 | |
| Rückstellungen für Abonnementsabgabe (Erläuterung 3) | -40 281.04 | |
| Rückstellungen für sonstige Kommissionen und Gebühren (Erläuterung 2) | -3 881.93 | |
| Total Rückstellungen für Aufwendungen | | -159 195.89 |
| **Total Passiva** | | **-5 324 963.91** |
| | | |
| **Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode** | | **324 435 551.13** |

## Ertrags- und Aufwandsrechnung

| | AUD |
|---|---|
| **Erträge** | **1.4.2016-30.9.2016** |
| Zinsertrag auf liquide Mittel | 36 019.21 |
| Zinsen auf Wertpapiere | 6 744 570.29 |
| **Total Erträge** | **6 780 589.50** |
| | |
| **Aufwendungen** | |
| Pauschale Verwaltungskommission (Erläuterung 2) | -1 443 807.13 |
| Abonnementsabgabe (Erläuterung 3) | -80 190.78 |
| Sonstige Kommissionen und Gebühren (Erläuterung 2) | -20 862.69 |
| **Total Aufwendungen** | **-1 544 860.60** |
| | |
| **Nettoerträge (-verluste) aus Anlagen** | **5 235 728.90** |
| | |
| **Realisierte Gewinne (Verluste) (Erläuterung 1)** | |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus marktbewerteten Wertpapieren ausser Optionen | 1 447 022.95 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten | 945 748.97 |
| Realisierter Währungsgewinn (-verlust) | 116.57 |
| **Total der realisierten Gewinne (Verluste)** | **2 392 888.49** |
| | |
| **Realisierter Nettogewinn (-verlust) der Berichtsperiode** | **7 628 617.39** |
| | |
| **Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung) (Erläuterung 1)** | |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) marktbewerteter Wertpapiere ausser Optionen | 4 377 098.45 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) renditebewerteter Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 48 960.00 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) von Finanzterminkontrakten | -133 765.37 |
| **Total der Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung)** | **4 292 293.08** |
| | |
| **Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens infolge Geschäftstätigkeit** | **11 920 910.47** |

## Veränderungen des Nettovermögens

| | AUD |
|---|---|
| | **1.4.2016-30.9.2016** |
| Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode | 344 153 838.38 |
| Zeichnungen | 53 505 466.10 |
| Rücknahmen | -81 251 509.70 |
| Total Mittelzufluss (-abfluss) | -27 746 043.60 |
| Ausbezahlte Dividende | -3 893 154.12 |
| Nettoerträge (-verluste) aus Anlagen | 5 235 728.90 |
| Total der realisierten Gewinne (Verluste) | 2 392 888.49 |
| Total der Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung) | 4 292 293.08 |
| Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens infolge Geschäftstätigkeit | 11 920 910.47 |
| **Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode** | **324 435 551.13** |

## Entwicklung der Anteile im Umlauf

| | **1.4.2016-30.9.2016** |
|---|---|
| **Klasse** | **F-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 6 245.0000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 605.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -1 475.0000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **5 375.0000** |
| **Klasse** | **I-A1-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 3 094.0000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 0.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -3 094.0000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **0.0000** |
| **Klasse** | **I-X-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 5 115.3280 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 0.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -5 115.3280 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **0.0000** |
| **Klasse** | **N-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 13 335.7000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 4 161.4820 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -894.0310 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **16 603.1510** |
| **Klasse** | **P-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 448 944.9690 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 83 196.6550 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -138 875.8740 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **393 265.7500** |
| **Klasse** | **P-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 931 489.7270 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 50 772.0760 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -87 677.2620 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **894 584.5410** |
| **Klasse** | **Q-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 61 422.4220 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 33 431.4420 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -2 606.3080 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **92 247.5560** |
| **Klasse** | **Q-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 43 300.1640 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 17 373.6460 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -6 935.8710 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **53 737.9390** |

## Jährliche Ausschüttung

| **UBS (Lux) Bond Fund** | **Ex-Date** | **Pay-Date** | **Währung** | **Betrag pro Anteil** |
|---|---|---|---|---|
| – AUD P-dist | 1.6.2016 | 6.6.2016 | AUD | 4.17 |
| – AUD Q-dist | 1.6.2016 | 6.6.2016 | AUD | 1.20 |

# Aufstellung der Wertpapierbestände und anderer Nettovermögenswerte per 30. September 2016

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in AUD NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|
| **Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden** | | | | |
| **Mortgage Backed Securities, variabler Zins** | | | | |
| **AUD** | | | | |
| AUD | MEDALLION TRUST-SUB FLR 13-22.08.45 | 3 500 000.00 | 3 576 755.00 | 1.10 |
| **Total AUD** | | | **3 576 755.00** | **1.10** |
| **Total Mortgage Backed Securities, variabler Zins** | | | **3 576 755.00** | **1.10** |
| **Notes, fester Zins** | | | | |
| **AUD** | | | | |
| AUD | AUSTRALIA 5.50000% 11-21.04.23 | 6 100 000.00 | 7 508 185.00 | 2.31 |
| AUD | INTL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVT 5.75000% 10-01.10.20 | 500 000.00 | 570 460.00 | 0.18 |
| AUD | NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 6.00000% 11-01.03.22 | 3 300 000.00 | 4 003 197.00 | 1.23 |
| AUD | NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 4.00000% 13-20.04.23 | 5 900 000.00 | 6 635 022.00 | 2.05 |
| AUD | QUEENSLAND TREASURY CORP 5.75000% 11-22.07.24 | 4 000 000.00 | 5 002 920.00 | 1.54 |
| AUD | SUNCORP-METWAY LTD 4.75000% 12-06.12.16 | 2 000 000.00 | 2 009 740.00 | 0.62 |
| AUD | SYDNEY AIRPORT FINANCE CO PTY LTD 7.75000% 11-06.07.18 | 1 000 000.00 | 1 085 550.00 | 0.33 |
| AUD | TREASURY CORP OF VICTORIA 6.00000% 09-15.06.20 | 4 800 000.00 | 5 534 448.00 | 1.71 |
| **Total AUD** | | | **32 349 522.00** | **9.97** |
| **Total Notes, fester Zins** | | | **32 349 522.00** | **9.97** |
| **Notes, variabler Zins** | | | | |
| **AUD** | | | | |
| AUD | AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKG-SUB 3M BBSW+275BP 12-20.06.22 | 19 000.00 | 1 916 665.34 | 0.59 |
| **Total AUD** | | | **1 916 665.34** | **0.59** |
| **Total Notes, variabler Zins** | | | **1 916 665.34** | **0.59** |
| **Medium-Term Notes, fester Zins** | | | | |
| **AUD** | | | | |
| AUD | APPLE INC-REG-S 2.65000% 16-10.06.20 | 3 300 000.00 | 3 334 683.00 | 1.03 |
| AUD | BARCLAYS BANK PLC 4.50000% 14-04.04.19 | 3 000 000.00 | 3 117 600.00 | 0.96 |
| AUD | BHP BILLITON FINANCE LTD 3.75000% 12-18.10.17 | 1 000 000.00 | 1 011 790.00 | 0.31 |
| AUD | COMMERZBANK AG 6.00000% 06-30.11.16 | 5 000 000.00 | 5 020 450.00 | 1.55 |
| AUD | EUROPEAN INVESTMENT BANK 6.50000% 09-07.08.19 | 6 500 000.00 | 7 292 025.00 | 2.25 |
| AUD | EUROPEAN INVESTMENT BANK 5.00000% 12-22.08.22 | 500 000.00 | 568 465.00 | 0.18 |
| AUD | EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.50000% 15-30.04.20 | 1 500 000.00 | 1 514 880.00 | 0.47 |
| AUD | EXPORT DEVELOPMENT CANADA 3.25000% 12-08.08.17 | 1 000 000.00 | 1 010 980.00 | 0.31 |
| AUD | FONTERRA CO-OPERATIVE GROUP LTD 4.50000% 14-30.06.21 | 1 500 000.00 | 1 592 325.00 | 0.49 |
| AUD | INTERNATIONAL FINANCE CORP 3.50000% 13-06.06.18 | 3 000 000.00 | 3 078 480.00 | 0.95 |
| AUD | INTERNATIONAL FINANCE CORP-REG-S 2.70000% 15-05.02.21 | 3 000 000.00 | 3 068 820.00 | 0.95 |
| AUD | INTL BK FOR RECONST&DEVT WORLD BK-REG-S 2.50000% 15-12.03.20 | 2 400 000.00 | 2 440 752.00 | 0.75 |
| AUD | INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 3.75000% 14-23.01.19 | 4 000 000.00 | 4 168 600.00 | 1.28 |
| AUD | JPMORGAN CHASE & CO 4.10000% 13-17.05.18 | 2 500 000.00 | 2 558 650.00 | 0.79 |
| AUD | KOMMUNALBANKEN AS 2.60000% 15-04.09.20 | 1 600 000.00 | 1 619 040.00 | 0.50 |
| AUD | KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 6.25000% 09-04.12.19 | 2 900 000.00 | 3 278 218.00 | 1.01 |
| AUD | KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 6.00000% 10-20.08.20 | 3 000 000.00 | 3 432 780.00 | 1.06 |
| AUD | KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 2.40000% 15-02.07.20 | 5 000 000.00 | 5 053 700.00 | 1.56 |
| AUD | KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 2.80000% 16-17.02.21 | 4 700 000.00 | 4 816 184.00 | 1.48 |
| AUD | LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 4.25000% 13-24.01.23 | 2 000 000.00 | 2 214 720.00 | 0.68 |
| AUD | METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 4.75000% 12-28.09.17 | 1 000 000.00 | 1 020 430.00 | 0.31 |
| AUD | NATIONAL WLTH MGT HLD 5.25000% 12-07.12.17 | 1 500 000.00 | 1 544 295.00 | 0.48 |
| AUD | PERTH AIRPORT PTY LTD 6.00000% 13-23.07.20 | 1 200 000.00 | 1 308 684.00 | 0.40 |
| AUD | PERTH AIRPORT PTY LTD 5.50000% 14-25.03.21 | 1 100 000.00 | 1 186 790.00 | 0.37 |
| AUD | SPI AUSTRALIA ASSETS PTY LTD 6.25000% 12-21.02.17 | 2 000 000.00 | 2 028 220.00 | 0.63 |
| AUD | SUNCORP-METWAY LTD-REG-S 4.00000% 12-09.11.17 | 2 000 000.00 | 2 039 940.00 | 0.63 |
| AUD | TOYOTA MOTOR CREDIT CORP-REG-S 2.75000% 16-26.07.21 | 2 400 000.00 | 2 417 016.00 | 0.74 |
| AUD | WESTPAC BANKING CORP 4.50000% 14-25.02.19 | 3 500 000.00 | 3 672 760.00 | 1.13 |
| **Total AUD** | | | **75 411 277.00** | **23.25** |
| **Total Medium-Term Notes, fester Zins** | | | **75 411 277.00** | **23.25** |
| **Anleihen, fester Zins** | | | | |
| **AUD** | | | | |
| AUD | AUSTRALIA 4.25000% 14-21.04.26 | 3 000 000.00 | 3 610 200.00 | 1.11 |
| AUD | AUSTRALIA 4.75000% 11-21.04.27 | 6 600 000.00 | 8 351 244.00 | 2.57 |
| AUD | AUSTRALIA 5.75000% 07-15.05.21 | 2 500 000.00 | 2 960 900.00 | 0.91 |
| AUD | AUSTRALIA 5.75000% 10-15.07.22 | 8 600 000.00 | 10 520 552.00 | 3.24 |
| AUD | AUSTRALIA-REG-S 2.75000% 14-21.06.35 | 5 400 000.00 | 5 625 450.00 | 1.73 |
| AUD | AUSTRALIA-REG-S 3.25000% 15-21.06.39 | 3 700 000.00 | 4 090 831.00 | 1.26 |
| AUD | AUSTRALIA-REG-S 3.25000% 13-21.04.25 | 9 300 000.00 | 10 302 354.00 | 3.18 |
| AUD | AUSTRALIA-REG-S 3.75000% 14-21.04.37 | 5 900 000.00 | 7 047 019.00 | 2.17 |
| AUD | AUSTRALIA-REG-S 4.50000% 13-21.04.33 | 6 700 000.00 | 8 722 127.00 | 2.69 |
| AUD | CROWN GROUP FINANCE LTD 5.75000% 12-18.07.17 | 2 400 000.00 | 2 454 672.00 | 0.76 |
| AUD | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 4.25000% 14-20.05.19 | 3 500 000.00 | 3 664 605.00 | 1.13 |
| AUD | QUEENSLAND TREASURY CORP 6.00000% 11-21.07.22 | 3 700 000.00 | 4 500 088.00 | 1.39 |
| AUD | QUEENSLAND TREASURY CORP-REG-S 4.00000% 12-21.06.19 | 1 000 000.00 | 1 058 870.00 | 0.33 |
| AUD | QUEENSLAND TREASURY CORP-REG-S 4.25000% 12-21.07.23 | 9 300 000.00 | 10 519 044.00 | 3.24 |
| AUD | QUEENSLAND TREASURY CORP-144A-REG-S 4.75000% 14-21.07.25 | 1 000 000.00 | 1 192 750.00 | 0.37 |
| AUD | WESTPAC BANKING CORP 5.75000% 12-06.02.17 | 5 000 000.00 | 5 065 150.00 | 1.56 |
| **Total AUD** | | | **89 685 856.00** | **27.64** |
| **Total Anleihen, fester Zins** | | | **89 685 856.00** | **27.64** |

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in AUD NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|
| **Anleihen, variabler Zins** | | | | |
| **AUD** | | | | |
| AUD | AUSTRALIA-REG-S 1.250%/CPI LINKED 12-21.02.22 | 4 100 000.00 | 4 686 587.00 | 1.44 |
| AUD | AUSTRALIA-REG-S 2.000%/CPI LINKED 13-21.08.35 | 1 500 000.00 | 1 961 505.00 | 0.61 |
| **Total AUD** | | | **6 648 092.00** | **2.05** |
| **Total Anleihen, variabler Zins** | | | **6 648 092.00** | **2.05** |
| **Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden** | | | **209 588 167.34** | **64.60** |

## Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Inländische Depositenzertifikate, fester Zins** | | | | |
| **AUD** | | | | |
| AUD | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA CD 3.75000% 18.07.14-18.10.19 | 1 500 000.00 | 1 555 830.00 | 0.48 |
| **Total AUD** | | | **1 555 830.00** | **0.48** |
| **Total Inländische Depositenzertifikate, fester Zins** | | | **1 555 830.00** | **0.48** |
| **Notes, fester Zins** | | | | |
| **AUD** | | | | |
| AUD | LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 6.25000% 11-13.04.18 | 500 000.00 | 532 615.00 | 0.16 |
| AUD | LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 5.50000% 12-29.03.22 | 1 000 000.00 | 1 162 660.00 | 0.36 |
| AUD | NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 5.00000% 12-20.08.24 | 1 200 000.00 | 1 458 192.00 | 0.45 |
| AUD | NEW SOUTH WALES TREASURY CORP 3.00000% 16-20.03.28 | 1 300 000.00 | 1 385 878.00 | 0.43 |
| AUD | TASMANIAN PUBLIC FINANCE CORP 4.25000% 13-08.03.22 | 1 000 000.00 | 1 112 580.00 | 0.34 |
| AUD | WESTERN AUSTRALIAN TREASURY-REG-S 5.00000% 13-23.07.25 | 3 500 000.00 | 4 205 565.00 | 1.30 |
| AUD | WESTERN AUSTRALIAN TREASURY CORP 2.50000% 15-22.07.20 | 10 500 000.00 | 10 701 810.00 | 3.30 |
| **Total AUD** | | | **20 559 300.00** | **6.34** |
| **Total Notes, fester Zins** | | | **20 559 300.00** | **6.34** |
| **Medium-Term Notes, fester Zins** | | | | |
| **AUD** | | | | |
| AUD | ADANI ABBOT POINT TERMINAL PTY LTD STEP-UP 13-01.11.18 | 2 000 000.00 | 1 991 060.00 | 0.61 |
| AUD | AIRSERVICES AUSTRALIA 4.75000% 13-19.11.20 | 1 100 000.00 | 1 202 905.00 | 0.37 |
| AUD | AURIZON NETWORK PTY LTD 5.75000% 13-28.10.20 | 1 500 000.00 | 1 605 675.00 | 0.49 |
| AUD | AUSTRALIA PACIFIC AIRPORTS MELB-STEP-DOWN 5.000% 13-04.06.20 | 1 000 000.00 | 1 074 240.00 | 0.33 |
| AUD | AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY 4.25000% 12-22.05.20 | 1 500 000.00 | 1 627 365.00 | 0.50 |
| AUD | BHP BILLITON FINANCE LTD-REG-S 3.00000% 15-30.03.20 | 2 300 000.00 | 2 313 938.00 | 0.71 |
| AUD | BRISBANE AIRPORT CORP LTD 8.00000% 11-09.07.19 | 600 000.00 | 679 128.00 | 0.21 |
| AUD | CALTEX AUSTRALIA LTD 7.25000% 11-23.11.18 | 1 000 000.00 | 1 091 470.00 | 0.34 |
| AUD | CITIGROUP INC 4.75000% 13-05.02.18 | 1 500 000.00 | 1 540 665.00 | 0.47 |
| AUD | COMPAGNIE DE FINANCEMENT FONCIER 6.25000% 07-30.01.17 | 2 900 000.00 | 2 936 743.00 | 0.91 |
| AUD | CONNECTEAST FINANCE PTY LTD 5.75000% 13-02.09.20 | 2 400 000.00 | 2 606 928.00 | 0.80 |
| AUD | CROWN GROUP FINANCE LTD-REG-S 4.50000% 14-18.11.19 | 1 600 000.00 | 1 648 448.00 | 0.51 |
| AUD | DEXUS FINANCE PROPERTY GROUP LTD 8.75000% 10-21.04.17 | 2 000 000.00 | 2 067 080.00 | 0.64 |
| AUD | DOWNER GROUP FINANCE PTY 5.75000% 13-29.11.18 | 1 500 000.00 | 1 560 900.00 | 0.48 |
| AUD | DOWNER GROUP FINANCE PTY LTD 4.50000% 15-11.03.22 | 900 000.00 | 906 678.00 | 0.28 |
| AUD | EXPORT FINANCE&INSURANCE CORP 6.00000% 10-12.11.20 | 1 600 000.00 | 1 847 520.00 | 0.57 |
| AUD | INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.75000% 12-25.07.22 | 2 100 000.00 | 2 266 908.00 | 0.70 |
| AUD | LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTEBANK 5.50000% 12-09.03.20 | 1 000 000.00 | 1 111 540.00 | 0.34 |
| AUD | MC FINANCE AUSTRALIA PTY-REG-S 4.75000% 13-17.12.18 | 1 000 000.00 | 1 042 830.00 | 0.32 |
| AUD | METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 4.50000% 14-16.04.19 | 3 000 000.00 | 3 123 540.00 | 0.96 |
| AUD | QPH FINANCE CO PTY LTD 5.75000% 13-29.07.20 | 1 000 000.00 | 1 094 190.00 | 0.34 |
| AUD | TOYOTA FINANCE AUSTRALIA LTD 4.25000% 13-26.02.18 | 3 300 000.00 | 3 389 166.00 | 1.04 |
| AUD | UNITED ENERGY LTD-REG-S 3.50000% 16-12.09.23 | 1 100 000.00 | 1 093 994.00 | 0.34 |
| AUD | UNIVERSITY OF MELBOURNE 4.25000% 14-30.06.21 | 1 000 000.00 | 1 077 920.00 | 0.33 |
| AUD | UNIVERSITY OF SYDNEY 4.75000% 14-16.04.21 | 2 200 000.00 | 2 417 074.00 | 0.76 |
| AUD | WSO FINANCE PTY LTD-REG-S 3.50000% 16-14.07.23 | 1 000 000.00 | 1 007 310.00 | 0.31 |
| **Total AUD** | | | **44 325 215.00** | **13.66** |
| **Total Medium-Term Notes, fester Zins** | | | **44 325 215.00** | **13.66** |
| **Medium-Term Notes, variabler Zins** | | | | |
| **AUD** | | | | |
| AUD | DBNGP FINANCE CO 6.000%/RATING LINKED 12-11.10.19 | 2 700 000.00 | 2 880 144.00 | 0.89 |
| **Total AUD** | | | **2 880 144.00** | **0.89** |
| **Total Medium-Term Notes, variabler Zins** | | | **2 880 144.00** | **0.89** |
| **Anleihen, fester Zins** | | | | |
| **AUD** | | | | |
| AUD | AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY 4.25000% 13-11.04.22 | 1 000 000.00 | 1 118 910.00 | 0.35 |
| AUD | SUNCORP-METWAY LTD-REG-S 3.75000% 14-05.11.19 | 2 200 000.00 | 2 280 938.00 | 0.70 |
| AUD | UNITED ENERGY LTD 6.25000% 12-11.04.17 | 2 000 000.00 | 2 035 480.00 | 0.63 |
| AUD | WESTERN AUSTRALIAN TREASURY CORP 3.00000% 16-21.10.27 | 3 000 000.00 | 3 097 860.00 | 0.95 |
| **Total AUD** | | | **8 533 188.00** | **2.63** |
| **Total Anleihen, fester Zins** | | | **8 533 188.00** | **2.63** |
| **Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | **77 853 677.00** | **24.00** |

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in AUD NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|

## Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht an einer offiziellen Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

**Inländische Depositenzertifikate, fester Zins**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **AUD** | | | | |
| AUD | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA CD 4.25000% 24.04.14-24.04.19 | 2 500 000.00 | 2 615 425.00 | 0.81 |
| **Total AUD** | | | **2 615 425.00** | **0.81** |
| **Total Inländische Depositenzertifikate, fester Zins** | | | **2 615 425.00** | **0.81** |

**Notes, fester Zins**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **AUD** | | | | |
| AUD | NORTHERN TERRITORY TREASURY CORP 6.00000% 08-15.03.26 | 2 500 000.00 | 3 258 525.00 | 1.00 |
| **Total AUD** | | | **3 258 525.00** | **1.00** |
| **Total Notes, fester Zins** | | | **3 258 525.00** | **1.00** |

**Medium-Term Notes, fester Zins**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **AUD** | | | | |
| AUD | AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING-REG-S 2.80000% 16-16.08.21 | 2 900 000.00 | 2 906 293.00 | 0.89 |
| AUD | AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY 2.50000% 16-21.05.26 | 1 000 000.00 | 1 017 430.00 | 0.31 |
| AUD | AUSTRALIAN RAIL TRACK CORP LTD 3.75000% 14-05.12.19 | 1 000 000.00 | 1 028 850.00 | 0.32 |
| AUD | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 2.90000% 16-12.07.21 | 3 600 000.00 | 3 632 580.00 | 1.12 |
| AUD | EXPORT DEVELOPMENT CANADA 2.40000% 16-07.06.21 | 2 800 000.00 | 2 820 748.00 | 0.87 |
| AUD | LGFV PROGRAM TRUST-REG-S 4.31000% 14-12.11.21 | 2 100 000.00 | 2 212 455.00 | 0.68 |
| AUD | VICTORIA POWER NETWORKS FINANCE PTY LTD 5.75000% 12-27.04.17 | 2 000 000.00 | 2 035 180.00 | 0.63 |
| **Total AUD** | | | **15 653 536.00** | **4.82** |
| **Total Medium-Term Notes, fester Zins** | | | **15 653 536.00** | **4.82** |

**Anleihen, fester Zins**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **AUD** | | | | |
| AUD | SUNCORP-METWAY LTD-REG-S 3.25000% 16-24.08.26 | 1 000 000.00 | 993 930.00 | 0.31 |
| **Total AUD** | | | **993 930.00** | **0.31** |
| **Total Anleihen, fester Zins** | | | **993 930.00** | **0.31** |
| **Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht an einer offiziellen Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | **22 521 416.00** | **6.94** |
| **Total des Wertpapierbestandes** | | | **309 963 260.34** | **95.54** |

# Derivative Instrumente

## Derivative Instrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden

**Financial Futures auf Anleihen**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| AUD | AUSTRALIA 3YR BOND FUTURE 15.12.16 | -116.00 | -14 629.92 | 0.00 |
| AUD | AUSTRALIA 10Y BOND FUT 15.12.16 | 90.00 | 134 099.37 | 0.04 |
| **Total Financial Futures auf Anleihen** | | | **119 469.45** | **0.04** |
| **Total Derivative Instrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden** | | | **119 469.45** | **0.04** |
| **Total Derivative Instrumente** | | | **119 469.45** | **0.04** |

| | | |
|---|---|---|
| **Festgelder und Treuhandanlagen** | **11 429 807.34** | **3.52** |
| **Bankguthaben, Sicht- und Fristgelder und andere liquide Mittel** | **132 501.80** | **0.04** |
| **Kontokorrentkredit und andere kurzfristige Verbindlichkeiten** | **-1 306.60** | **0.00** |
| **Andere Aktiva und Passiva** | **2 791 818.80** | **0.86** |
| **Total des Nettovermögens** | **324 435 551.13** | **100.00** |

# UBS (Lux) Bond Fund – CAD

## Wichtigste Daten

| | ISIN | 23.9.2016 | 31.3.2016 | 31.3.2015 |
|---|---|---|---|---|
| Nettovermögen in CAD | | 145 543 923.24 | 176 863 844.09 | 206 321 201.40 |
| **Klasse F-acc** | **LU0415160620** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 13 220.0000 | 23 930.0000 | 26 745.5780 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CAD | | 435.18 | 427.06 | 421.88 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CAD[1] | | 435.18 | 427.06 | 421.88 |
| **Klasse P-acc** | **LU0033048686** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 243 589.1190 | 298 731.7370 | 371 565.7630 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CAD | | 426.88 | 420.14 | 417.55 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CAD[1] | | 426.88 | 420.14 | 417.55 |
| **Klasse P-dist** | **LU0033047795** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 214 740.4320 | 256 619.1170 | 288 430.4840 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CAD | | 129.45 | 129.85 | 131.68 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CAD[1] | | 129.45 | 129.85 | 131.68 |
| **Klasse Q-acc** | **LU0415160976** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 59 714.0120 | 49 316.2890 | 9 810.8270 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CAD | | 114.56 | 112.54 | 111.41 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CAD[1] | | 114.56 | 112.54 | 111.41 |
| **Klasse Q-dist** | **LU0415160893** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 10 917.8370 | 21 069.9240 | 7 507.6280 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CAD | | 106.93 | 107.45 | 108.95 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CAD[1] | | 106.93 | 107.45 | 108.95 |

[1] Siehe Erläuterung 1

## Struktur des Wertpapierbestandes

Da der Subfonds UBS (Lux) Bond Fund – CAD per 23. September 2016 in den Subfonds UBS (Lux) Bond Fund – Global (CHF) fusioniert wurde, gibt es zum Ende der Berichtsperiode weder einen Wertpapierbestand noch eine Struktur des Wertpapierbestandes. Siehe Erläuterung 9.

## Ertrags- und Aufwandsrechnung

| | CAD |
|---|---|
| **Erträge** | **1.4.2016-30.9.2016** |
| Zinsertrag auf liquide Mittel | 152.58 |
| Zinsen auf Wertpapiere | 2 190 223.36 |
| Erträge aus Securities Lending (Erläuterung 11) | 40 493.18 |
| Sonstige Erträge | 5 167.45 |
| **Total Erträge** | **2 236 036.57** |
| | |
| **Aufwendungen** | |
| Kosten aus Securities Lending (Erläuterung 11) | -16 197.27 |
| Pauschale Verwaltungskommission (Erläuterung 2) | -705 466.29 |
| Abonnementsabgabe (Erläuterung 3) | -37 984.07 |
| Sonstige Kommissionen und Gebühren (Erläuterung 2) | -31 652.99 |
| Zinsaufwand auf liquide Mittel und Kontokorrentkredit | -269.20 |
| **Total Aufwendungen** | **-791 569.82** |
| | |
| **Nettoerträge (-verluste) aus Anlagen** | **1 444 466.75** |
| | |
| **Realisierte Gewinne (Verluste) (Erläuterung 1)** | |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus marktbewerteten Wertpapieren ausser Optionen | 10 754 709.15 |
| Realisierter Währungsgewinn (-verlust) | 13.12 |
| **Total der realisierten Gewinne (Verluste)** | **10 754 722.27** |
| | |
| **Realisierter Nettogewinn (-verlust) der Berichtsperiode** | **12 199 189.02** |
| | |
| **Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung) (Erläuterung 1)** | |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) marktbewerteter Wertpapiere ausser Optionen | -9 293 200.24 |
| **Total der Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung)** | **-9 293 200.24** |
| | |
| **Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens infolge Geschäftstätigkeit** | **2 905 988.78** |

## Veränderungen des Nettovermögens

| | | CAD |
|---|---|---|
| | | **1.4.2016-30.9.2016** |
| Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode | | 176 863 844.09 |
| Zeichnungen | 16 819 415.53 | |
| Rücknahmen | -195 904 311.67 | |
| Total Mittelzufluss (-abfluss) | | -179 084 896.14 |
| Ausbezahlte Dividende | | -684 936.73 |
| Nettoerträge (-verluste) aus Anlagen | 1 444 466.75 | |
| Total der realisierten Gewinne (Verluste) | 10 754 722.27 | |
| Total der Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung) | -9 293 200.24 | |
| Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens infolge Geschäftstätigkeit | | 2 905 988.78 |
| **Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode** | | **0.00** |

## Entwicklung der Anteile im Umlauf

| | **1.4.2016-30.9.2016** |
|---|---|
| **Klasse** | **F-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 23 930.0000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 1 179.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -25 109.0000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **0.0000** |
| **Klasse** | **P-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 298 731.7370 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 25 636.6000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -324 368.3370 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **0.0000** |
| **Klasse** | **P-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 256 619.1170 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 10 668.0490 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -267 287.1660 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **0.0000** |
| **Klasse** | **Q-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 49 316.2890 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 23 958.2210 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -73 274.5100 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **0.0000** |
| **Klasse** | **Q-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 21 069.9240 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 12 402.9330 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -33 472.8570 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **0.0000** |

# UBS (Lux) Bond Fund – CHF

## Wichtigste Daten

| | ISIN | 30.9.2016 | 31.3.2016 | 31.3.2015 |
|---|---|---|---|---|
| Nettovermögen in CHF | | 493 590 760.44 | 442 258 593.22 | 533 945 266.59 |
| **Klasse F-acc** | **LU0415163566** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 29 112.4920 | 29 941.5010 | 52 728.8610 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 2 714.24 | 2 672.84 | 2 633.22 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF[1] | | 2 714.24 | 2 672.84 | 2 633.22 |
| **Klasse F-dist** | **LU0415163483** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 1 045.0000 | 3 290.0000 | 5 065.0000 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 1 209.77 | 1 209.87 | 1 212.82 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF[1] | | 1 209.77 | 1 209.87 | 1 212.82 |
| **Klasse I-A1-acc** | **LU0415164028** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 351 599.0000 | 537 129.0000 | 111 531.0000 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 108.88 | 107.33 | 105.97 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF[1] | | 108.88 | 107.33 | 105.97 |
| **Klasse I-A3-acc[2]** | **LU0415164531** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 831 868.0000 | - | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 100.15 | - | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF[1] | | 100.15 | - | - |
| **Klasse N-acc[3]** | **LU0415162758** | | | |
| Anteile im Umlauf | | - | - | 2 346.2750 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | - | - | 104.58 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF[1] | | - | - | 104.58 |
| **Klasse P-acc** | **LU0010001369** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 69 254.8420 | 72 999.6370 | 95 674.7160 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 2 654.44 | 2 623.06 | 2 602.11 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF[1] | | 2 654.44 | 2 623.06 | 2 602.11 |
| **Klasse P-dist** | **LU0010001286** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 78 580.7410 | 83 000.8500 | 106 623.3020 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 1 200.78 | 1 196.83 | 1 199.88 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF[1] | | 1 200.78 | 1 196.83 | 1 199.88 |
| **Klasse Q-acc[4]** | **LU0415163723** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 100 948.8440 | 74 202.9510 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 102.55 | 101.14 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF[1] | | 102.55 | 101.14 | - |
| **Klasse Q-dist[4]** | **LU0415163640** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 31 064.1750 | 22 492.2510 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 101.97 | 101.14 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF[1] | | 101.97 | 101.14 | - |

[1] Siehe Erläuterung 1
[2] Erste NAV 10.8.2016
[3] Die Anteilsklasse N-acc war bis zum 22.2.2016 im Umlauf
[4] Erste NAV 5.10.2015

## Struktur des Wertpapierbestandes

| Geographische Aufteilung in % des Nettovermögens | |
|---|---|
| Vereinigte Staaten | 14.71 |
| Frankreich | 13.33 |
| Niederlande | 12.20 |
| Supranational | 11.25 |
| Österreich | 5.39 |
| Australien | 4.31 |
| Grossbritannien | 4.16 |
| Schweden | 3.08 |
| Kanada | 2.96 |
| Luxemburg | 2.20 |
| Chile | 2.05 |
| Südkorea | 2.01 |
| Deutschland | 1.83 |
| Mexiko | 1.66 |
| Spanien | 1.43 |
| Jersey | 1.26 |
| Guernsey | 1.13 |
| Neuseeland | 1.09 |
| Polen | 1.06 |
| Schweiz | 0.86 |
| Russische Föderation (GUS) | 0.86 |
| Kasachstan | 0.78 |
| Brasilien | 0.77 |
| Curaçao | 0.73 |
| Irland | 0.71 |
| Cayman-Inseln | 0.66 |
| Finnland | 0.65 |
| Dänemark | 0.62 |
| Slowakei | 0.42 |
| Hongkong | 0.42 |
| Bermuda | 0.24 |
| Norwegen | 0.22 |
| **Total** | **95.05** |

| Wirtschaftliche Aufteilung in % des Nettovermögens | |
|---|---|
| Banken & Kreditinstitute | 41.12 |
| Finanz- & Beteiligungsgesellschaften | 15.98 |
| Supranationale Organisationen | 11.25 |
| Erdöl | 2.91 |
| Pfandbriefinstitute & Refinanzierungsgesellschaften | 2.55 |
| Verkehr & Transport | 2.53 |
| Öffentlich-rechtliche Körperschaften | 2.26 |
| Kantone, Bundesstaaten | 2.24 |
| Telekommunikation | 2.20 |
| Nahrungsmittel & Softdrinks | 2.10 |
| Tabak & alkoholische Getränke | 1.59 |
| Länder- & Zentralregierungen | 1.48 |
| Pharmazeutik, Kosmetik & medizinische Produkte | 1.47 |
| Computer & Netzwerkausrüster | 0.86 |
| Immobilien | 0.76 |
| Städte, Gemeinden | 0.75 |
| Biotechnologie | 0.62 |
| Versicherungen | 0.52 |
| Flugzeug- & Raumfahrtindustrie | 0.42 |
| Baugewerbe & Baumaterial | 0.42 |
| Energie- & Wasserversorgung | 0.41 |
| Gastgewerbe & Freizeit | 0.31 |
| Elektronik & Halbleiter | 0.30 |
| **Total** | **95.05** |

## Nettovermögensaufstellung

| | | CHF |
|---|---|---|
| **Aktiva** | | **30.9.2016** |
| Wertpapierbestand, Einstandswert | 449 145 150.78 | |
| Wertpapierbestand, nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) | 19 990 051.72 | |
| Total Wertpapierbestand (Erläuterung 1) | | 469 135 202.50 |
| Bankguthaben, Sicht- und Fristgelder | | 24 249 653.87 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen (Erläuterung 1) | | 1 073 878.47 |
| Forderungen aus Zeichnungen | | 5 396 324.98 |
| Zinsforderungen aus Wertpapieren | | 3 814 156.27 |
| Nicht realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Swaps (Erläuterung 1) | | 580 826.80 |
| **Total Aktiva** | | **504 250 042.89** |
| | | |
| **Passiva** | | |
| Zinsverbindlichkeiten aus Kontokorrentkredit | | -6 194.85 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen (Erläuterung 1) | | -10 056 212.50 |
| Verbindlichkeiten aus Rücknahmen | | -422 580.21 |
| Rückstellungen für pauschale Verwaltungskommission (Erläuterung 2) | -128 123.23 | |
| Rückstellungen für Abonnementsabgabe (Erläuterung 3) | -41 510.90 | |
| Rückstellungen für sonstige Kommissionen und Gebühren (Erläuterung 2) | -4 660.76 | |
| Total Rückstellungen für Aufwendungen | | -174 294.89 |
| **Total Passiva** | | **-10 659 282.45** |
| | | |
| **Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode** | | **493 590 760.44** |

## Ertrags- und Aufwandsrechnung

| | CHF |
|---|---|
| **Erträge** | **1.4.2016-30.9.2016** |
| Zinsen auf Wertpapiere | 3 764 889.21 |
| Erträge aus Securities Lending (Erläuterung 11) | 7 014.63 |
| Sonstige Erträge | 131 352.02 |
| **Total Erträge** | **3 903 255.86** |
| | |
| **Aufwendungen** | |
| Kosten aus Securities Lending (Erläuterung 11) | -2 805.85 |
| Pauschale Verwaltungskommission (Erläuterung 2) | -1 555 714.23 |
| Abonnementsabgabe (Erläuterung 3) | -82 353.08 |
| Sonstige Kommissionen und Gebühren (Erläuterung 2) | -25 728.62 |
| Zinsaufwand auf liquide Mittel und Kontokorrentkredit | -13 728.20 |
| **Total Aufwendungen** | **-1 680 329.98** |
| | |
| **Nettoerträge (-verluste) aus Anlagen** | **2 222 925.88** |
| | |
| **Realisierte Gewinne (Verluste) (Erläuterung 1)** | |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus marktbewerteten Wertpapieren ausser Optionen | 1 573 084.27 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Swaps | 464 855.66 |
| Realisierter Währungsgewinn (-verlust) | -17.45 |
| **Total der realisierten Gewinne (Verluste)** | **2 037 922.48** |
| | |
| **Realisierter Nettogewinn (-verlust) der Berichtsperiode** | **4 260 848.36** |
| | |
| **Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung) (Erläuterung 1)** | |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) marktbewerteter Wertpapiere ausser Optionen | 1 224 222.51 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) renditebewerteter Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | -2 916.03 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) von Swaps | 239 229.13 |
| **Total der Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung)** | **1 460 535.61** |
| | |
| **Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens infolge Geschäftstätigkeit** | **5 721 383.97** |

## Veränderungen des Nettovermögens

| | CHF |
|---|---|
| | **1.4.2016-30.9.2016** |
| Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode | 442 258 593.22 |
| Zeichnungen | 140 761 324.28 |
| Rücknahmen | -94 251 363.95 |
| Total Mittelzufluss (-abfluss) | 46 509 960.33 |
| Ausbezahlte Dividende | -899 177.08 |
| Nettoerträge (-verluste) aus Anlagen | 2 222 925.88 |
| Total der realisierten Gewinne (Verluste) | 2 037 922.48 |
| Total der Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung) | 1 460 535.61 |
| Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens infolge Geschäftstätigkeit | 5 721 383.97 |
| **Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode** | **493 590 760.44** |

## Entwicklung der Anteile im Umlauf

| | **1.4.2016-30.9.2016** |
|---|---|
| **Klasse** | **F-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 29 941.5010 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 4 831.7160 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -5 660.7250 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **29 112.4920** |
| **Klasse** | **F-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 3 290.0000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 380.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -2 625.0000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **1 045.0000** |
| **Klasse** | **I-A1-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 537 129.0000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 265 203.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -450 733.0000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **351 599.0000** |
| **Klasse** | **I-A3-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 0.0000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 836 452.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -4 584.0000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **831 868.0000** |
| **Klasse** | **P-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 72 999.6370 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 2 317.0080 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -6 061.8030 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **69 254.8420** |
| **Klasse** | **P-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 83 000.8500 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 3 438.9030 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -7 859.0120 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **78 580.7410** |
| **Klasse** | **Q-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 74 202.9510 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 32 547.3920 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -5 801.4990 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **100 948.8440** |
| **Klasse** | **Q-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 22 492.2510 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 12 381.3820 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -3 809.4580 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **31 064.1750** |

## Jährliche Ausschüttung

| **UBS (Lux) Bond Fund** | **Ex-Date** | **Pay-Date** | **Währung** | **Betrag pro Anteil** |
|---|---|---|---|---|
| – CHF F-dist | 1.6.2016 | 6.6.2016 | CHF | 10.29 |
| – CHF P-dist | 1.6.2016 | 6.6.2016 | CHF | 18.69 |
| – CHF Q-dist | 1.6.2016 | 6.6.2016 | CHF | 0.58 |

# Aufstellung der Wertpapierbestände und anderer Nettovermögenswerte per 30. September 2016

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in CHF NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|

## Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden

### Notes, fester Zins

**CHF**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| CHF | AMERICA MOVIL SAB DE CV 1.12500% 12-12.09.18 | 3 000 000.00 | 3 060 000.00 | 0.62 |
| CHF | AT&T INC-REG-S 1.37500% 14-04.12.24 | 2 000 000.00 | 2 212 000.00 | 0.45 |
| CHF | BANCO DE CHILE 1.12500% 13-23.05.18 | 1 000 000.00 | 1 022 000.00 | 0.21 |
| CHF | BANCO NACIONAL DE DESENV ECO&SOC 2.75000% 11-15.12.16 | 2 275 000.00 | 2 284 100.00 | 0.46 |
| CHF | BHARTI AIRTEL INTL NETHERLANDS BV 3.00000% 14-31.03.20 | 1 600 000.00 | 1 724 000.00 | 0.35 |
| CHF | CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 2.37500% 12-05.03.24 | 2 500 000.00 | 3 025 000.00 | 0.61 |
| CHF | CENTRAL AMERICAN BK ECO INTEGRAT 1.50000% 13-04.02.20 | 1 500 000.00 | 1 584 000.00 | 0.32 |
| CHF | EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.62500% 11-23.11.23 | 2 000 000.00 | 2 319 000.00 | 0.47 |
| CHF | EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.12500% 12-26.04.23 | 1 000 000.00 | 1 115 000.00 | 0.23 |
| CHF | EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.62500% 14-04.02.25 | 3 500 000.00 | 4 131 750.00 | 0.84 |
| CHF | KAZAKHSTAN TEMIR ZHOLY JSC 3.63800% 14-20.06.22 | 3 900 000.00 | 3 876 600.00 | 0.78 |
| CHF | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 2.00000% 11-06.12.21 | 3 550 000.00 | 3 933 400.00 | 0.80 |
| CHF | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 1.62500% 14-16.05.24 | 3 500 000.00 | 3 899 000.00 | 0.79 |
| CHF | SB CAPITAL SA FOR SBERBANK LPN 2.06500% 13-28.02.17 | 600 000.00 | 602 400.00 | 0.12 |
| CHF | SLOVAKIA, REPUBLIC OF 2.12500% 12-25.04.18 | 2 000 000.00 | 2 078 000.00 | 0.42 |
| CHF | SOCIETE GENERALE SA 0.87500% 13-19.06.18 | 1 250 000.00 | 1 271 250.00 | 0.26 |
| CHF | TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE IV BV 1.50000% 12-25.10.18 | 3 500 000.00 | 3 615 500.00 | 0.73 |
| **Total CHF** | | | **41 753 000.00** | **8.46** |
| **Total Notes, fester Zins** | | | **41 753 000.00** | **8.46** |

### Medium-Term Notes, fester Zins

**CHF**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| CHF | ABN AMRO BANK NV 1.12500% 14-31.01.19 | 1 000 000.00 | 1 030 500.00 | 0.21 |
| CHF | ACHMEA BANK NV 3.50000% 07-22.08.17 | 1 600 000.00 | 1 660 640.00 | 0.34 |
| CHF | AKADEMISKA HUS AB 0.25000% 15-17.11.25 | 1 000 000.00 | 1 056 000.00 | 0.21 |
| CHF | ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LDN 0.25000% 16-25.10.23 | 2 000 000.00 | 2 031 000.00 | 0.41 |
| CHF | AUCKLAND COUNCIL 1.50000% 14-28.11.25 | 3 175 000.00 | 3 711 575.00 | 0.75 |
| CHF | AUSNET SERVICES HOLDINGS PTY LTD 1.12500% 12-18.04.19 | 2 000 000.00 | 2 063 000.00 | 0.42 |
| CHF | AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP 1.50000% 12-13.02.19 | 1 600 000.00 | 1 678 400.00 | 0.34 |
| CHF | BANCO DE CREDITO E INVERSIONES-REG-S 0.87500% 14-23.11.18 | 1 500 000.00 | 1 521 750.00 | 0.31 |
| CHF | BANCO DO BRASIL CAYMAN 2.50000% 13-20.06.19 | 1 500 000.00 | 1 506 750.00 | 0.31 |
| CHF | BANCO SAFRA CAYMAN ISLANDS-REG-S 1.85000% 14-27.06.17 | 3 220 000.00 | 3 240 930.00 | 0.66 |
| CHF | BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV 2.50000% 05-21.07.25 | 5 000 000.00 | 6 292 500.00 | 1.27 |
| CHF | BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV 2.25000% 05-14.10.20 | 2 500 000.00 | 2 790 000.00 | 0.57 |
| CHF | BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV 2.12500% 10-06.11.18 | 2 000 000.00 | 2 117 000.00 | 0.43 |
| CHF | BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV 1.25000% 14-30.04.24 | 2 000 000.00 | 2 258 000.00 | 0.46 |
| CHF | BANK OF AMERICA CORP 2.50000% 05-28.09.17 | 2 500 000.00 | 2 576 250.00 | 0.52 |
| CHF | BANK OF NOVA SCOTIA/THE 0.30000% 15-16.09.22 | 1 500 000.00 | 1 538 250.00 | 0.31 |
| CHF | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 2.00000% 14-22.05.24 | 2 500 000.00 | 2 846 250.00 | 0.58 |
| CHF | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUT 0.55000% 15-08.12.23 | 1 000 000.00 | 1 032 000.00 | 0.21 |
| CHF | BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 0.62500% 14-08.09.21 | 1 600 000.00 | 1 672 800.00 | 0.34 |
| CHF | BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 1.37500% 14-08.09.26 | 2 000 000.00 | 2 271 000.00 | 0.46 |
| CHF | BAYERISCHE LANDESBANK-SUB 3.12500% 06-12.10.16 | 1 210 000.00 | 1 210 484.00 | 0.25 |
| CHF | BNP PARIBAS 1.87500% 12-12.09.22 | 3 000 000.00 | 3 340 500.00 | 0.68 |
| CHF | BPCE SA 1.50000% 14-30.04.21 | 2 000 000.00 | 2 135 000.00 | 0.43 |
| CHF | BUNDESIMMOBILIEN GESELLSCHAFT MBH 3.25000% 07-16.07.19 | 2 000 000.00 | 2 212 000.00 | 0.45 |
| CHF | CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SOCIALE 2.37500% 11-19.04.23 | 4 835 000.00 | 5 731 892.50 | 1.16 |
| CHF | CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 2.50000% 11-29.03.21 | 1 500 000.00 | 1 702 500.00 | 0.34 |
| CHF | CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 1.87500% 12-23.05.22 | 2 500 000.00 | 2 823 750.00 | 0.57 |
| CHF | CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE/CAD 1.00000% 12-13.02.19 | 2 000 000.00 | 2 071 000.00 | 0.42 |
| CHF | CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE/CAD 0.12500% 15-22.12.25 | 1 500 000.00 | 1 560 750.00 | 0.32 |
| CHF | CENTRAL AMERICAN BANK ECO INTEGRAT 1.87500% 14-25.02.22 | 2 500 000.00 | 2 750 000.00 | 0.56 |
| CHF | CHINA CONSTRUCT BK ASIA CORP LTD 1.37500% 14-28.05.19 | 2 000 000.00 | 2 062 000.00 | 0.42 |
| CHF | CITIGROUP INC 3.12500% 06-27.09.21 | 2 500 000.00 | 2 887 500.00 | 0.58 |
| CHF | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 1.50000% 12-13.09.19 | 4 000 000.00 | 4 230 000.00 | 0.86 |
| CHF | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 1.50000% 14-07.02.22 | 4 000 000.00 | 4 344 000.00 | 0.88 |
| CHF | COMPAGNIE DE FINANCEMENT FONCIER 2.37500% 05-24.08.18 | 2 500 000.00 | 2 648 750.00 | 0.54 |
| CHF | COMPAGNIE DE FINANCEMENT FONCIER 2.87500% 09-10.09.19 | 4 000 000.00 | 4 416 000.00 | 0.89 |
| CHF | CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 1.50000% 13-13.08.20 | 3 000 000.00 | 3 202 500.00 | 0.65 |
| CHF | CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 2.00000% 14-05.02.24 | 5 300 000.00 | 6 073 800.00 | 1.23 |
| CHF | CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 1.50000% 14-01.12.28 | 1 500 000.00 | 1 729 500.00 | 0.35 |
| CHF | CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.15000% 16-24.02.22 | 1 500 000.00 | 1 520 250.00 | 0.31 |
| CHF | CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 1.12500% 14-05.06.24 | 1 250 000.00 | 1 396 875.00 | 0.28 |
| CHF | CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 0.50000% 15-16.03.27 | 1 700 000.00 | 1 831 750.00 | 0.37 |
| CHF | CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 0.25000% 15-18.06.26 | 2 000 000.00 | 2 116 000.00 | 0.43 |
| CHF | CREDIT AGRICOLE SA 1.25000% 14-17.07.20 | 2 500 000.00 | 2 626 250.00 | 0.53 |
| CHF | CREDIT AGRICOLE SA LONDON 2.12500% 14-30.10.24 | 2 000 000.00 | 2 317 000.00 | 0.47 |
| CHF | CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 1.00000% 14-08.10.21 | 1 800 000.00 | 1 908 000.00 | 0.39 |
| CHF | CREDIT AGRICOLE SA LONDON 0.62500% 15-15.09.23 | 2 000 000.00 | 2 078 000.00 | 0.42 |
| CHF | CREDIT SUISSE GRP FDNG GUERNSEY 1.00000% 15-14.04.23 | 3 000 000.00 | 3 042 000.00 | 0.62 |
| CHF | CREDIT SUISSE GRP FDNG GUERNSEY-REG-S 0.62500% 15-21.08.20 | 2 500 000.00 | 2 517 500.00 | 0.51 |
| CHF | CREDIT SUISSE LONDON BRANCH-REG-S 1.00000% 14-24.09.21 | 2 000 000.00 | 2 100 000.00 | 0.43 |
| CHF | CREDIT SUISSE NEW YORK BRANCH-SUB 4.87500% 08-14.03.18 | 4 000 000.00 | 4 256 000.00 | 0.86 |
| CHF | DANSKE BANK AS 2.25000% 10-12.09.17 | 3 000 000.00 | 3 082 500.00 | 0.62 |
| CHF | DEUTSCHE BAHN FINANCE BV 1.50000% 11-18.12.17 | 2 500 000.00 | 2 566 250.00 | 0.52 |
| CHF | DEUTSCHE BANK AG 0.62500% 15-19.12.23 | 1 000 000.00 | 950 000.00 | 0.19 |
| CHF | DEUTSCHE BANK AG 0.75000% 16-05.07.21 | 1 000 000.00 | 983 500.00 | 0.20 |
| CHF | EDP FINANCE BV 4.00000% 12-29.11.18 | 750 000.00 | 798 000.00 | 0.16 |
| CHF | ELI LILLY & CO-REG-S 0.15000% 16-24.05.24 | 1 750 000.00 | 1 791 125.00 | 0.36 |
| CHF | ELI LILLY & CO-REG-S 0.45000% 16-24.05.28 | 1 750 000.00 | 1 828 750.00 | 0.37 |
| CHF | ENGIE SA 1.50000% 11-20.10.17 | 2 000 000.00 | 2 038 600.00 | 0.41 |
| CHF | EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.37500% 05-10.07.20 | 3 000 000.00 | 3 361 500.00 | 0.68 |
| CHF | EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.00000% 10-24.08.22 | 2 000 000.00 | 2 315 000.00 | 0.47 |
| CHF | EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.50000% 12-02.08.24 | 3 400 000.00 | 3 954 200.00 | 0.80 |

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in CHF NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|
| CHF | EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 1.12500% 14-03.09.19 | 1 500 000.00 | 1 557 750.00 | 0.32 |
| CHF | GAS NATURAL FINANCE BV 2.12500% 13-08.02.19 | 1 800 000.00 | 1 890 000.00 | 0.38 |
| CHF | GAZ CAPITAL SA/GAZPROM LPN 2.85000% 13-25.10.19 | 700 000.00 | 722 400.00 | 0.15 |
| CHF | GENERAL ELECTRIC CO 4.50000% 08-09.10.18 | 2 000 000.00 | 2 197 000.00 | 0.45 |
| CHF | GLENCORE FINANCE EUROPE SA 2.62500% 12-03.12.18 | 2 000 000.00 | 2 082 000.00 | 0.42 |
| CHF | GLENCORE FINANCE EUROPE SA 2.12500% 13-23.12.19 | 1 200 000.00 | 1 249 200.00 | 0.25 |
| CHF | GLENCORE FINANCE EUROPE SA 2.25000% 16-10.05.21 | 2 500 000.00 | 2 655 000.00 | 0.54 |
| CHF | GOLDMAN SACHS GROUP INC 1.25000% 14-11.09.19 | 1 500 000.00 | 1 559 250.00 | 0.32 |
| CHF | GOLDMAN SACHS GROUP INC 0.55000% 16-09.09.21 | 2 200 000.00 | 2 266 000.00 | 0.46 |
| CHF | HEATHROW FUNDING LTD 0.50000% 16-17.05.24 | 2 000 000.00 | 2 059 000.00 | 0.42 |
| CHF | HOLCIM OVERSEAS FINANCE LTD 3.37500% 11-10.06.21 | 1 000 000.00 | 1 163 500.00 | 0.24 |
| CHF | HSBC SFH FRANCE SA-REG-S 2.37500% 10-07.09.18 | 3 000 000.00 | 3 172 500.00 | 0.64 |
| CHF | HYPO NOE GRUPPE BANK AG 0.12500% 16-17.10.23 | 500 000.00 | 498 130.00 | 0.10 |
| CHF | HYPO TIROL BANK AG 2.75000% 06-17.10.16 | 1 900 000.00 | 1 900 190.00 | 0.38 |
| CHF | ILE DE FRANCE 3.25000% 07-27.11.18 | 1 500 000.00 | 1 621 500.00 | 0.33 |
| CHF | ING BANK NV 1.87500% 10-29.08.18 | 2 950 000.00 | 3 094 550.00 | 0.63 |
| CHF | INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL 3.25000% 07-28.06.24 | 3 000 000.00 | 3 673 500.00 | 0.74 |
| CHF | JPMORGAN CHASE & CO 0.50000% 15-04.12.23 | 5 000 000.00 | 5 185 000.00 | 1.05 |
| CHF | JPMORGAN CHASE & CO 0.45000% 16-11.11.26 | 1 000 000.00 | 1 030 500.00 | 0.21 |
| CHF | KOMMUNALKREDIT AUSTRIA AG 2.37500% 05-15.03.17 | 1 970 000.00 | 1 990 291.00 | 0.40 |
| CHF | KOREA NATIONAL OIL CORP 1.87500% 12-08.03.17 | 3 500 000.00 | 3 532 200.00 | 0.72 |
| CHF | KOREA RAILROAD CORP 1.50000% 13-02.12.19 | 3 150 000.00 | 3 332 700.00 | 0.68 |
| CHF | MCDONALD'S CORP 0.17000% 16-04.10.24 | 1 500 000.00 | 1 511 535.00 | 0.31 |
| CHF | METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.75000% 14-17.04.19 | 2 000 000.00 | 2 046 000.00 | 0.41 |
| CHF | METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 1.00000% 14-19.09.22 | 2 000 000.00 | 2 139 000.00 | 0.43 |
| CHF | MFINANCE FRANCE SA 2.50000% 13-08.10.18 | 1 500 000.00 | 1 554 000.00 | 0.31 |
| CHF | MORGAN STANLEY 3.12500% 06-21.11.18 | 1 000 000.00 | 1 073 000.00 | 0.22 |
| CHF | MUNICIPALITY FINANCE PLC 0.87500% 13-01.02.23 | 1 000 000.00 | 1 090 000.00 | 0.22 |
| CHF | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 1.12500% 12-07.11.18 | 3 000 000.00 | 3 090 000.00 | 0.63 |
| CHF | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 1.50000% 14-07.02.24 | 2 500 000.00 | 2 871 250.00 | 0.58 |
| CHF | NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV 2.37500% 05-19.08.20 | 3 000 000.00 | 3 352 500.00 | 0.68 |
| CHF | NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV 2.62500% 07-07.02.22 | 1 550 000.00 | 1 831 325.00 | 0.37 |
| CHF | NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV 2.25000% 10-03.09.19 | 2 000 000.00 | 2 169 000.00 | 0.44 |
| CHF | NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV 1.87500% 10-03.02.20 | 1 000 000.00 | 1 084 500.00 | 0.22 |
| CHF | NETWORK RAIL INFRASTRUCTURE FINANCE 2.750% 06-06.10.21 | 5 000 000.00 | 5 882 500.00 | 1.19 |
| CHF | NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.50000% 14-13.05.19 | 2 400 000.00 | 2 444 400.00 | 0.50 |
| CHF | NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING 0.37500% 15-02.02.22 | 1 250 000.00 | 1 291 250.00 | 0.26 |
| CHF | NORDEA BANK AB 0.25000% 15-27.11.23 | 2 000 000.00 | 2 052 000.00 | 0.42 |
| CHF | NORDEA BANK AB 0.55000% 15-23.06.25 | 1 800 000.00 | 1 883 700.00 | 0.38 |
| CHF | NORGES STATSBANER AS 1.12500% 13-02.05.23 | 1 000 000.00 | 1 082 000.00 | 0.22 |
| CHF | ONTARIO, PROVINCE OF 2.37500% 10-07.05.20 | 3 000 000.00 | 3 325 500.00 | 0.67 |
| CHF | OP CORPORATE BANK PLC 1.00000% 14-14.07.21 | 2 000 000.00 | 2 121 000.00 | 0.43 |
| CHF | PETROLEOS MEXICANOS 2.50000% 12-10.04.19 | 3 000 000.00 | 3 109 500.00 | 0.63 |
| CHF | PETROLEOS MEXICANOS 1.50000% 15-08.12.20 | 2 000 000.00 | 2 025 000.00 | 0.41 |
| CHF | PFANDBRIEFBANK OESTERREICH AG 2.12500% 05-07.11.16 | 2 230 000.00 | 2 233 345.00 | 0.45 |
| CHF | POLAND, REPUBLIC OF 2.25000% 12-15.05.18 | 3 000 000.00 | 3 120 000.00 | 0.63 |
| CHF | POLAND, REPUBLIC OF-REG-S 1.00000% 14-17.09.21 | 2 000 000.00 | 2 111 000.00 | 0.43 |
| CHF | QUEBEC, PROVINCE OF 1.12500% 13-22.02.23 | 4 000 000.00 | 4 396 000.00 | 0.89 |
| CHF | QUEBEC, PROVINCE OF 1.50000% 14-05.02.24 | 1 500 000.00 | 1 705 500.00 | 0.35 |
| CHF | RABOBANK NEDERLAND NV 2.00000% 10-16.09.21 | 3 000 000.00 | 3 324 000.00 | 0.67 |
| CHF | SANTANDER CONSUMER FINANCE SA 0.60000% 16-23.03.21 | 1 200 000.00 | 1 227 000.00 | 0.25 |
| CHF | SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 0.37500% 15-21.08.23 | 4 000 000.00 | 4 156 000.00 | 0.84 |
| CHF | SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 0.87500% 15-21.08.28 | 4 400 000.00 | 4 840 000.00 | 0.98 |
| CHF | SNCF RESEAU 3.00000% 09-24.04.19 | 4 000 000.00 | 4 356 000.00 | 0.88 |
| CHF | SVENSK EXPORTKREDIT AB 3.00000% 09-27.02.18 | 3 500 000.00 | 3 675 000.00 | 0.74 |
| CHF | SVENSK EXPORTKREDIT AB 1.25000% 13-17.07.23 | 2 000 000.00 | 2 240 000.00 | 0.45 |
| CHF | SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S 0.62500% 14-11.12.18 | 1 200 000.00 | 1 225 200.00 | 0.25 |
| CHF | SWEDBANK HYPOTEK AB 1.62500% 10-08.12.17 | 3 000 000.00 | 3 078 000.00 | 0.62 |
| CHF | TELEFONICA EMISIONES SA 2.71800% 12-14.12.18 | 1 000 000.00 | 1 060 500.00 | 0.21 |
| CHF | TELEFONICA EMISIONES SAU 2.59500% 13-23.10.20 | 1 000 000.00 | 1 096 500.00 | 0.22 |
| CHF | TELSTRA CORP LTD 1.75000% 11-14.12.18 | 900 000.00 | 941 850.00 | 0.19 |
| CHF | TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 1.00000% 14-29.08.24 | 2 400 000.00 | 2 594 400.00 | 0.53 |
| CHF | UNICREDIT BANK (IRELAND) PLC 4.25000% 12-19.10.22 | 1 200 000.00 | 1 447 800.00 | 0.29 |
| CHF | UNICREDIT BANK (IRELAND) PLC 3.375% 12-25.10.17 | 2 000 000.00 | 2 072 800.00 | 0.42 |
| CHF | VINCI SA 2.12500% 11-15.12.17 | 2 000 000.00 | 2 054 000.00 | 0.42 |
| CHF | VODAFONE GROUP PLC 0.37500% 16-03.12.24 | 1 250 000.00 | 1 281 250.00 | 0.26 |
| CHF | VODAFONE GROUP PLC 0.50000% 16-19.09.31 | 1 200 000.00 | 1 195 200.00 | 0.24 |
| CHF | VORARLBERGER LANDES-& HYPOTHEKENBANK AG 0.12500% 16-06.10.21 | 700 000.00 | 702 450.00 | 0.14 |
| CHF | WELLS FARGO & CO-REG-S 0.62500% 14-03.09.20 | 2 000 000.00 | 2 059 000.00 | 0.42 |
| CHF | WELLS FARGO & CO-REG-S 0.50000% 15-02.11.23 | 2 800 000.00 | 2 913 400.00 | 0.59 |
| CHF | WESTPAC BANKING CORP 0.50000% 15-02.02.22 | 2 000 000.00 | 2 065 000.00 | 0.42 |
| CHF | WESTPAC SECURITIES NZ LTD/LONDON 0.37500% 16-05.02.24 | 1 600 000.00 | 1 646 400.00 | 0.33 |
| **Total CHF** | | | **315 684 287.50** | **63.96** |
| **Total Medium-Term Notes, fester Zins** | | | **315 684 287.50** | **63.96** |
| **Medium-Term Notes, variabler Zins** | | | | |
| **CHF** | | | | |
| CHF | ALLIANZ SE 3.25000%/VAR 14-PRP | 2 400 000.00 | 2 547 600.00 | 0.51 |
| CHF | ROYAL BANK OF SCOTLAND PLC-SUB 9.375%/VAR 12-16.03.22 | 2 100 000.00 | 2 156 700.00 | 0.44 |
| **Total CHF** | | | **4 704 300.00** | **0.95** |
| **Total Medium-Term Notes, variabler Zins** | | | **4 704 300.00** | **0.95** |
| **Anleihen, fester Zins** | | | | |
| **CHF** | | | | |
| CHF | AMGEN INC 0.41000% 16-08.03.23 | 3 000 000.00 | 3 069 000.00 | 0.62 |
| CHF | APPLE INC-REG-S 0.37500% 15-25.11.24 | 1 500 000.00 | 1 566 000.00 | 0.32 |
| CHF | APPLE INC-REG-S 0.75000% 15-25.02.30 | 2 500 000.00 | 2 697 500.00 | 0.55 |
| CHF | BANCO DE CHILE 1.50000% 13-03.12.19 | 2 150 000.00 | 2 252 125.00 | 0.46 |
| CHF | BANCO DE CREDITO E INVERSIONES 0.25000% 15-17.06.20 | 3 000 000.00 | 3 019 500.00 | 0.61 |
| CHF | BANCO SANTANDER CHILE 1.75000% 13-26.09.19 | 1 200 000.00 | 1 257 000.00 | 0.25 |
| CHF | BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 1.75000% 14-28.02.24 | 1 700 000.00 | 1 921 850.00 | 0.39 |
| CHF | CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 2.50000% 09-02.05.18 | 3 000 000.00 | 3 145 500.00 | 0.64 |

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in CHF NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|
| CHF | CENTRAL AMERICAN BANK ECO INTEGRAT 1.50000% 13-16.12.19 | 1 500 000.00 | 1 578 000.00 | 0.32 |
| CHF | CENTRAL AMERICAN BK ECO INTEGRAT 1.12500% 14-24.02.23 | 1 600 000.00 | 1 707 200.00 | 0.35 |
| CHF | COCA-COLA CO/THE 1.00000% 15-02.10.28 | 1 500 000.00 | 1 665 750.00 | 0.34 |
| CHF | COCA-COLA CO/THE-REG-S 0.25000% 15-22.12.22 | 2 000 000.00 | 2 074 000.00 | 0.42 |
| CHF | DH SWITZERLAND FINANCE SA-REG-S 0.50000% 15-08.12.23 | 1 200 000.00 | 1 246 200.00 | 0.25 |
| CHF | EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 2.87500% 13-05.12.18 | 1 000 000.00 | 1 045 000.00 | 0.21 |
| CHF | EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.62500% 10-11.02.25 | 2 500 000.00 | 3 158 750.00 | 0.64 |
| CHF | EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.37500% 13-21.02.28 | 4 000 000.00 | 4 790 000.00 | 0.97 |
| CHF | EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.75000% 13-28.06.33 | 3 500 000.00 | 4 632 250.00 | 0.94 |
| CHF | EUROPEAN INVESTMNT BANK 1.62500% 12-02.04.26 | 2 500 000.00 | 2 995 000.00 | 0.61 |
| CHF | GAZ CAPITAL SA/GAZPROM-REG-S LPN 3.37500% 16-30.11.18 | 2 200 000.00 | 2 289 100.00 | 0.46 |
| CHF | GENERAL ELECTRIC CO 3.12500% 04-06.12.19 | 4 000 000.00 | 4 442 000.00 | 0.90 |
| CHF | GENERAL ELECTRIC CO 2.50000% 06-08.02.18 | 2 500 000.00 | 2 603 500.00 | 0.53 |
| CHF | GENERAL ELECTRIC CO 1.62500% 12-19.10.17 | 1 000 000.00 | 1 022 800.00 | 0.21 |
| CHF | KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.25000% 10-12.08.20 | 3 000 000.00 | 3 358 500.00 | 0.68 |
| CHF | LG ELECTRONICS INC 2.00000% 12-02.12.16 | 1 500 000.00 | 1 504 650.00 | 0.30 |
| CHF | MONDELEZ INTL 1.12500% 15-21.12.23 | 1 000 000.00 | 1 063 000.00 | 0.21 |
| CHF | MONDELEZ INTL-REG-S 0.62500% 15-30.12.21 | 1 600 000.00 | 1 650 400.00 | 0.33 |
| CHF | MONDELEZ INTL-REG-S 1.12500% 15-30.12.25 | 2 200 000.00 | 2 367 200.00 | 0.48 |
| CHF | MONDELEZ INTL-REG-S 0.65000% 16-26.07.22 | 1 500 000.00 | 1 542 000.00 | 0.31 |
| CHF | OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 2.75000% 05-28.01.20 | 3 000 000.00 | 3 343 500.00 | 0.68 |
| CHF | OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 2.87500% 05-25.02.30 | 3 000 000.00 | 4 272 000.00 | 0.87 |
| CHF | OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 2.62500% 06-22.11.24 | 3 500 000.00 | 4 383 750.00 | 0.89 |
| CHF | OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 3.00000% 07-14.06.22 | 2 870 000.00 | 3 461 220.00 | 0.70 |
| CHF | OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 1.00000% 12-28.09.21 | 1 500 000.00 | 1 623 750.00 | 0.33 |
| CHF | RABOBANK NEDERLAND NV 3.12500% 06-15.09.26 | 4 300 000.00 | 5 626 550.00 | 1.14 |
| CHF | RUSSIAN RAILWAYS (RZD) 2.73000% 13-26.02.21 | 1 200 000.00 | 1 244 400.00 | 0.25 |
| CHF | RZD CAPITAL PLC 2.17700% 13-26.02.18 | 2 940 000.00 | 2 978 220.00 | 0.60 |
| CHF | TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE 0.50000% 16-28.07.22 | 1 750 000.00 | 1 792 875.00 | 0.36 |
| CHF | TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE 1.00000% 16-28.07.25 | 2 475 000.00 | 2 616 075.00 | 0.53 |
| CHF | UBS GROUP FUNDING JERSEY LTD-REG-S 0.75000% 16-22.02.22 | 2 000 000.00 | 2 060 000.00 | 0.42 |
| CHF | UBS GROUP FUNDING JERSEY LTD-REG-S 1.25000% 16-23.02.26 | 2 000 000.00 | 2 120 000.00 | 0.43 |
| **Total CHF** | | | **101 186 115.00** | **20.50** |
| **Total Anleihen, fester Zins** | | | **101 186 115.00** | **20.50** |
| **Anleihen, Nullcoupon** | | | | |
| **CHF** | | | | |
| CHF | INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.00000% 86-26.11.21 | 2 500 000.00 | 2 597 500.00 | 0.53 |
| **Total CHF** | | | **2 597 500.00** | **0.53** |
| **Total Anleihen, Nullcoupon** | | | **2 597 500.00** | **0.53** |
| **Anleihen, variabler Zins** | | | | |
| **CHF** | | | | |
| CHF | RABOBANK NEDERLAND NV-SUB 5.500%/6M LIBOR+280BP 08-PRP | 3 000 000.00 | 3 210 000.00 | 0.65 |
| **Total CHF** | | | **3 210 000.00** | **0.65** |
| **Total Anleihen, variabler Zins** | | | **3 210 000.00** | **0.65** |
| **Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden** | | | **469 135 202.50** | **95.05** |
| **Total des Wertpapierbestandes** | | | **469 135 202.50** | **95.05** |

## Derivative Instrumente

### Derivative Instrumente, die nicht an einer offiziellen Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Swaps und Forward-Swaps auf Zinssätze** | | | | |
| CHF | UBS/INTEREST RATE SWAP REC 0.56750% 15-03.02.35 | 5 000 000.00 | 572 478.70 | 0.12 |
| CHF | UBS/INTEREST RATE SWAP PAYER 6ML 15-03.02.35 | | | |
| CHF | UBS/INTEREST RATE SWAP REC -0.08750% 16-03.10.31 | 5 000 000.00 | 8 348.10 | 0.00 |
| CHF | UBS/INTEREST RATE SWAP PAYER 6ML 16-03.10.31 | | | |
| **Total Swaps und Forward-Swaps auf Zinssätze** | | | **580 826.80** | **0.12** |
| **Total Derivative Instrumente, die nicht an einer offiziellen Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | **580 826.80** | **0.12** |
| **Total Derivative Instrumente** | | | **580 826.80** | **0.12** |
| **Bankguthaben, Sicht- und Fristgelder und andere liquide Mittel** | | | **24 249 653.87** | **4.91** |
| **Andere Aktiva und Passiva** | | | **-374 922.73** | **-0.08** |
| **Total des Nettovermögens** | | | **493 590 760.44** | **100.00** |

# UBS (Lux) Bond Fund – Convert Europe (EUR)

## Wichtigste Daten

| | ISIN | 30.9.2016 | 31.3.2016 | 31.3.2015 |
|---|---|---|---|---|
| Nettovermögen in EUR | | 772 732 920.64 | 826 880 601.24 | 802 156 355.21 |
| **Klasse F-acc** | **LU0415178838** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 31 596.8200 | 79 714.7900 | 87 122.7900 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 168.51 | 161.02 | 169.24 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 167.67 | 161.02 | 170.09 |
| **Klasse I-A1-acc** | **LU0415179133** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 344 872.2450 | 316 696.6800 | 171 629.8000 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 121.61 | 116.27 | 122.33 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 121.00 | 116.27 | 122.94 |
| **Klasse (CHF hedged) I-A1-acc[2]** | **LU1331651429** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 35 112.0000 | 40 655.0000 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 102.19 | 97.98 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF[1] | | 101.68 | 97.98 | - |
| **Klasse I-A1-dist** | **LU0804734944** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 389 318.6350 | 231 339.4040 | 227 029.4040 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 126.80 | 122.60 | 130.99 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 126.17 | 122.60 | 131.64 |
| **Klasse I-X-acc** | **LU0415180065** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 138 789.6550 | 167 630.2120 | 183 872.3980 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 119.74 | 114.19 | 119.55 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 119.14 | 114.19 | 120.15 |
| **Klasse (CHF hedged) I-X-acc[3]** | **LU1415541744** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 323 100.2890 | - | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 102.10 | - | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF[1] | | 101.59 | - | - |
| **Klasse I-X-dist** | **LU0415179992** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 1 466 444.9380 | 4 009 188.6760 | 3 318 418.5430 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 112.75 | 109.27 | 116.72 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 112.19 | 109.27 | 117.30 |
| **Klasse K-1-acc** | **LU0415178242** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 0.5000 | 0.7000 | 0.2000 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 5 081 692.14 | 4 871 992.34 | 5 154 886.50 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 5 056 283.68 | 4 871 992.34 | 5 180 660.93 |
| **Klasse P-acc** | **LU0108066076** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 1 068 436.4340 | 1 233 705.6570 | 1 365 449.1140 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 160.85 | 154.82 | 165.09 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 160.05 | 154.82 | 165.92 |
| **Klasse (CHF hedged) P-acc** | **LU0776290768** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 119 428.5960 | 132 322.4930 | 276 738.2600 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 131.83 | 127.25 | 136.78 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF[1] | | 131.17 | 127.25 | 137.46 |
| **Klasse P-dist** | **LU0108060624** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 145 428.7840 | 98 962.1720 | 106 968.9680 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 145.75 | 140.30 | 150.04 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 145.02 | 140.30 | 150.79 |
| **Klasse Q-acc** | **LU0358408184** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 299 785.1890 | 355 958.8590 | 279 902.5850 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 171.47 | 164.30 | 173.62 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 170.61 | 164.30 | 174.49 |
| **Klasse (CHF hedged) Q-acc[4]** | **LU1240769197** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 69 589.1430 | 56 878.6020 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 100.50 | 96.57 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF[1] | | 100.00 | 96.57 | - |
| **Klasse Q-dist[4]** | **LU0415178911** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 10 213.6520 | 7 603.4000 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 100.88 | 96.98 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 100.38 | 96.98 | - |
| **Klasse U-X-dist[5]** | **LU0415180149** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 18 465.5200 | - | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 10 380.19 | - | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 10 328.29 | - | - |

[1] Siehe Erläuterung 1
[2] Erste NAV 23.12.2015
[3] Erste NAV 1.6.2016
[4] Erste NAV 11.9.2015
[5] Erste NAV 21.4.2016

## Struktur des Wertpapierbestandes

| Geographische Aufteilung in % des Nettovermögens | |
|---|---|
| Niederlande | 19.75 |
| Frankreich | 10.13 |
| Jersey | 8.14 |
| Grossbritannien | 7.77 |
| Luxemburg | 7.19 |
| Deutschland | 6.47 |
| Österreich | 5.60 |
| Italien | 4.92 |
| Schweiz | 4.69 |
| Zypern | 3.72 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 2.93 |
| Belgien | 2.27 |
| Mexiko | 1.99 |
| Ungarn | 1.44 |
| Norwegen | 1.34 |
| Cayman-Inseln | 1.14 |
| Finnland | 1.00 |
| Irland | 1.00 |
| Spanien | 0.54 |
| Bermuda | 0.01 |
| **Total** | **92.04** |

| Wirtschaftliche Aufteilung in % des Nettovermögens | |
|---|---|
| Finanz- & Beteiligungsgesellschaften | 27.58 |
| Immobilien | 13.20 |
| Banken & Kreditinstitute | 7.53 |
| Diverse nicht klassierte Gesellschaften | 6.88 |
| Baugewerbe & Baumaterial | 4.51 |
| Telekommunikation | 4.47 |
| Diverse Dienstleistungen | 4.06 |
| Erdöl | 3.51 |
| Internet, Software & IT-Dienste | 2.95 |
| Pharmazeutik, Kosmetik & medizinische Produkte | 2.53 |
| Elektrische Geräte & Komponenten | 2.31 |
| Verkehr & Transport | 2.20 |
| Bergbau, Kohle & Stahl | 2.04 |
| Versicherungen | 1.58 |
| Landwirtschaft & Fischerei | 1.34 |
| Energie- & Wasserversorgung | 1.04 |
| Elektronik & Halbleiter | 1.01 |
| Nichteisenmetalle | 1.00 |
| Gesundheits- & Sozialwesen | 1.00 |
| Gastgewerbe & Freizeit | 0.76 |
| Chemie | 0.53 |
| Edelmetalle und -steine | 0.01 |
| **Total** | **92.04** |

## Nettovermögensaufstellung

| | | EUR |
|---|---|---|
| **Aktiva** | | **30.9.2016** |
| Wertpapierbestand, Einstandswert | 724 956 800.87 | |
| Wertpapierbestand, nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) | -13 698 967.84 | |
| Total Wertpapierbestand (Erläuterung 1) | | 711 257 833.03 |
| Bankguthaben, Sicht- und Fristgelder | | 56 432 425.35 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen (Erläuterung 1) | | 217 994.04 |
| Forderungen aus Zeichnungen | | 66 162.29 |
| Zinsforderungen aus Wertpapieren | | 2 838 740.25 |
| Zinsforderungen aus liquiden Mitteln | | 569.98 |
| Nicht realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Devisenterminkontrakten (Erläuterung 1) | | 3 029 194.55 |
| **Total Aktiva** | | **773 842 919.49** |
| | | |
| **Passiva** | | |
| Zinsverbindlichkeiten aus Kontokorrentkredit | | -8 590.33 |
| Verbindlichkeiten aus Rücknahmen | | -852 480.20 |
| Rückstellungen für pauschale Verwaltungskommission (Erläuterung 2) | -194 337.48 | |
| Rückstellungen für Abonnementsabgabe (Erläuterung 3) | -46 207.91 | |
| Rückstellungen für sonstige Kommissionen und Gebühren (Erläuterung 2) | -8 382.93 | |
| Total Rückstellungen für Aufwendungen | | -248 928.32 |
| **Total Passiva** | | **-1 109 998.85** |
| | | |
| **Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode** | | **772 732 920.64** |

## Ertrags- und Aufwandsrechnung

| | EUR |
|---|---|
| **Erträge** | **1.4.2016-30.9.2016** |
| Zinsertrag auf liquide Mittel | 2 772.75 |
| Zinsen auf Wertpapiere | 6 785 510.73 |
| Erträge aus Securities Lending (Erläuterung 11) | 209 962.86 |
| Sonstige Erträge | 594 125.85 |
| **Total Erträge** | **7 592 372.19** |
| | |
| **Aufwendungen** | |
| Kosten aus Securities Lending (Erläuterung 11) | -83 985.14 |
| Pauschale Verwaltungskommission (Erläuterung 2) | -2 402 580.85 |
| Abonnementsabgabe (Erläuterung 3) | -93 490.76 |
| Sonstige Kommissionen und Gebühren (Erläuterung 2) | -31 163.14 |
| Zinsaufwand auf liquide Mittel und Kontokorrentkredit | -44 774.72 |
| Sonstige Aufwendungen | -42 720.94 |
| **Total Aufwendungen** | **-2 698 715.55** |
| | |
| **Nettoerträge (-verluste) aus Anlagen** | **4 893 656.64** |
| | |
| **Realisierte Gewinne (Verluste) (Erläuterung 1)** | |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus marktbewerteten Wertpapieren ausser Optionen | 11 622 837.21 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus renditebewerteten Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten | -225 254.71 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Devisenterminkontrakten | 4 700 197.76 |
| Realisierter Währungsgewinn (-verlust) | 327 007.09 |
| **Total der realisierten Gewinne (Verluste)** | **16 424 787.35** |
| | |
| **Realisierter Nettogewinn (-verlust) der Berichtsperiode** | **21 318 443.99** |
| | |
| **Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung) (Erläuterung 1)** | |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) marktbewerteter Wertpapiere ausser Optionen | 12 929 234.35 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) renditebewerteter Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | -626 886.12 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) von Devisenterminkontrakten | 797 178.70 |
| **Total der Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung)** | **13 099 526.93** |
| | |
| **Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens infolge Geschäftstätigkeit** | **34 417 970.92** |



Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil des Berichtes.

## Veränderungen des Nettovermögens

| | EUR |
|---|---|
| | **1.4.2016-30.9.2016** |
| Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode | 826 880 601.24 |
| Zeichnungen | 421 066 808.90 |
| Rücknahmen | -507 045 445.06 |
| Total Mittelzufluss (-abfluss) | -85 978 636.16 |
| Ausbezahlte Dividende | -2 587 015.36 |
| Nettoerträge (-verluste) aus Anlagen | 4 893 656.64 |
| Total der realisierten Gewinne (Verluste) | 16 424 787.35 |
| Total der Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung) | 13 099 526.93 |
| Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens infolge Geschäftstätigkeit | 34 417 970.92 |
| **Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode** | **772 732 920.64** |

## Entwicklung der Anteile im Umlauf

| | **1.4.2016-30.9.2016** |
|---|---|
| **Klasse** | **F-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 79 714.7900 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 0.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -48 117.9700 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **31 596.8200** |
| **Klasse** | **I-A1-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 316 696.6800 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 54 880.5650 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -26 705.0000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **344 872.2450** |
| **Klasse** | **(CHF hedged) I-A1-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 40 655.0000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 289.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -5 832.0000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **35 112.0000** |
| **Klasse** | **I-A1-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 231 339.4040 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 157 979.2310 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | 0.0000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **389 318.6350** |
| **Klasse** | **I-X-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 167 630.2120 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 55 352.7980 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -84 193.3550 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **138 789.6550** |
| **Klasse** | **(CHF hedged) I-X-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 0.0000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 326 547.6780 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -3 447.3890 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **323 100.2890** |
| **Klasse** | **I-X-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 4 009 188.6760 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 202 267.0140 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -2 745 010.7520 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **1 466 444.9380** |
| **Klasse** | **K-1-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 0.7000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 0.2000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -0.4000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **0.5000** |
| **Klasse** | **P-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 1 233 705.6570 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 56 249.7970 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -221 519.0200 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **1 068 436.4340** |
| **Klasse** | **(CHF hedged) P-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 132 322.4930 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 4 100.2490 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -16 994.1460 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **119 428.5960** |
| **Klasse** | **P-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 98 962.1720 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 55 009.3790 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -8 542.7670 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **145 428.7840** |

| **Klasse** | **Q-acc** |
|---|---|
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 355 958.8590 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 98 929.3860 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -155 103.0560 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **299 785.1890** |
| **Klasse** | **(CHF hedged) Q-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 56 878.6020 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 18 189.2700 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -5 478.7290 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **69 589.1430** |
| **Klasse** | **Q-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 7 603.4000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 2 860.8580 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -250.6060 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **10 213.6520** |
| **Klasse** | **U-X-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 0.0000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 30 000.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -11 534.4800 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **18 465.5200** |

## Jährliche Ausschüttung

| **UBS (Lux) Bond Fund** | **Ex-Date** | **Pay-Date** | **Währung** | **Betrag pro Anteil** |
|---|---|---|---|---|
| – Convert Europe (EUR) I-A1-dist | 1.6.2016 | 6.6.2016 | EUR | 1.39 |
| – Convert Europe (EUR) I-X-dist | 1.6.2016 | 6.6.2016 | EUR | 1.79 |
| – Convert Europe (EUR) Q-dist | 1.6.2016 | 6.6.2016 | EUR | 0.32 |

# Aufstellung der Wertpapierbestände und anderer Nettovermögenswerte per 30. September 2016

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in EUR NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|
| **Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden** | | | | |
| **Anleihen mit Warrant, fester Zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAP NV-REG-S 1.65000% 15-16.08.19 | 14 000 000.00 | 14 462 181.89 | 1.87 |
| **Total USD** | | | **14 462 181.89** | **1.87** |
| **Total Anleihen mit Warrant, fester Zins** | | | **14 462 181.89** | **1.87** |
| **Wandelanleihen, fester Zins** | | | | |
| **CHF** | | | | |
| CHF | BALOISE HOLDING 1.50000% 09-17.11.16 | 13 200 000.00 | 12 205 324.91 | 1.58 |
| CHF | BASILEA PHARMACEUTICA-REG-S 2.75000% 15-23.12.22 | 8 500 000.00 | 8 107 527.06 | 1.05 |
| CHF | BKW AG-REG-S 0.12500% 14-30.09.20 | 7 160 000.00 | 8 025 370.61 | 1.04 |
| CHF | IMPLENIA AG-SUB 0.50000% 15-30.06.22 | 8 000 000.00 | 7 873 754.10 | 1.02 |
| **Total CHF** | | | **36 211 976.68** | **4.69** |
| **EUR** | | | | |
| EUR | AABAR INVESTMENTS PJSC-REG-S 1.00000% 15-27.03.22 | 31 500 000.00 | 22 680 000.00 | 2.94 |
| EUR | ACS ACTIVIDADES FINANCE BV-REG-S 2.62500% 13-22.10.18 | 13 100 000.00 | 15 100 763.00 | 1.95 |
| EUR | ALSTRIA OFFICE REIT-AG-REG-S 2.75000% 13-14.06.18 | 2 700 000.00 | 3 632 175.00 | 0.47 |
| EUR | AMERICA MOVIL BV-REG-S 5.50000% 15-17.09.18 | 17 100 000.00 | 15 389 487.00 | 1.99 |
| EUR | AMORIM ENERGIA BV-REG-S 3.37500% 13-03.06.18 | 9 500 000.00 | 9 609 250.00 | 1.24 |
| EUR | ARCANDOR AG *DEFAULT* 8.87500% 08-11.07.13* | 2 500 000.00 | 0.25 | 0.00 |
| EUR | AROUNDTOWN PROPERTY HOLDINGS PLC-REG-S 3.00000% 15-05.05.20 | 11 700 000.00 | 15 624 180.00 | 2.02 |
| EUR | ASTALDI SPA-REG-S 4.50000% 13-31.01.19 | 9 100 000.00 | 8 062 600.00 | 1.04 |
| EUR | AURELIUS AG-REG-S 1.00000% 15-01.12.20 | 6 700 000.00 | 8 177 350.00 | 1.06 |
| EUR | BENI STABILI SPA SIIQ-REG-S 2.62500% 13-17.04.19 | 10 700 000.00 | 11 530 320.00 | 1.49 |
| EUR | DEUTSCHE POST AG-REG-S 0.60000% 12-06.12.19 | 6 000 000.00 | 8 238 120.00 | 1.07 |
| EUR | DEUTSCHE WOHNEN AG-REG-S 0.87500% 14-08.09.21 | 4 500 000.00 | 7 252 875.00 | 0.94 |
| EUR | ETABLISSEMENTS MAUREL & PROM-REG-S 2.75000% 15-01.07.21 | 402 000.00 | 4 193 914.53 | 0.54 |
| EUR | FONCIERE DES REGIONS 3.34000% 11-01.01.17 | 80 222.00 | 7 795 922.77 | 1.01 |
| EUR | IMMOFINANZ AG 4.25000% 11-08.03.18 | 4 434 272.00 | 19 818 739.37 | 2.57 |
| EUR | KLOECKNER & CO FINANCIAL SERVICES SA 2.00000% 16-08.09.23 | 7 800 000.00 | 7 827 300.00 | 1.01 |
| EUR | KONINKLIJKE BAM GROEP NV-REG-S SUB 3.50000% 16-13.06.21 | 7 200 000.00 | 7 527 600.00 | 0.97 |
| EUR | MAIRE TECNIMONT SPA-REG-S 5.75000% 14-20.02.19 | 3 500 000.00 | 4 131 295.00 | 0.53 |
| EUR | MARINE HARVEST ASA-REG-S 0.87500% 14-06.05.19 | 6 300 000.00 | 10 349 451.00 | 1.34 |
| EUR | NEXITY SA-REG-S 0.12500% 16-01.01.23 | 179 400.00 | 12 114 009.40 | 1.57 |
| EUR | ORPEA-REG-S 1.75000% 13-01.01.20 | 93 000.00 | 7 742 386.15 | 1.00 |
| EUR | OUTOKUMPU OYJ-REG-S 3.25000% 15-26.02.20 | 7 700 000.00 | 7 750 127.00 | 1.00 |
| EUR | PIERRE ET VACANCES-REG-S 3.50000% 14-01.10.19 | 147 856.00 | 5 910 867.53 | 0.77 |
| EUR | PT JERSEY LTD-REG-S 0.50000% 14-19.11.19 | 6 200 000.00 | 7 414 890.00 | 0.96 |
| EUR | ROCKET INTERNET SE-REG-S 3.00000% 15-22.07.22 | 13 100 000.00 | 11 271 764.00 | 1.46 |
| EUR | SACYR VALLEHERMOSO SA-REG-S 4.00000% 14-08.05.19 | 5 600 000.00 | 4 159 288.00 | 0.54 |
| EUR | SALZGITTER FINANCE BV 2.00000% 10-08.11.17 | 13 350 000.00 | 15 215 395.50 | 1.97 |
| EUR | SIEM INDUSTRIES INC 2.25000% 16-02.06.21 | 5 500 000.00 | 5 962 000.00 | 0.77 |
| EUR | SOCIETA INIZIATIVE AUTOSTRADALI E SERVI 2.62500% 05-30.06.17 | 2 786 343.00 | 2 829 809.95 | 0.37 |
| EUR | STEINHOFF FINANCE HOLDING GMBH-REG-S 4.00000% 14-30.01.21 | 2 300 000.00 | 3 340 819.00 | 0.43 |
| EUR | STEINHOFF FINANCE HOLDING GMBH-REG-S 1.25000% 15-11.08.22 | 17 200 000.00 | 17 718 924.00 | 2.29 |
| EUR | TELECOM ITALIA SPA-REG-S 1.12500% 15-26.03.22 | 11 800 000.00 | 11 426 648.00 | 1.48 |
| EUR | VASTNED RETAIL-REG-S 1.87500% 14-10.04.19 | 7 200 000.00 | 7 319 664.00 | 0.95 |
| **Total EUR** | | | **307 117 935.45** | **39.74** |
| **GBP** | | | | |
| GBP | BALFOUR BEATTY FINANCE NO.2 LTD-REG-S 1.87500% 13-03.12.18 | 6 200 000.00 | 7 204 417.21 | 0.93 |
| GBP | BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 1.00000% 16-28.04.23 | 5 800 000.00 | 7 688 397.01 | 1.00 |
| GBP | INTU JERSEY-REG-S 2.50000% 12-04.10.18 | 4 800 000.00 | 5 818 798.72 | 0.75 |
| GBP | PHP FINANCE JERSEY LTD-REG-S 4.25000% 14-20.05.19 | 6 000 000.00 | 7 919 114.57 | 1.03 |
| GBP | REMGRO JERSEY GBP LTD-REG-S 2.62500% 16-22.03.21 | 6 200 000.00 | 7 578 655.90 | 0.98 |
| **Total GBP** | | | **36 209 383.41** | **4.69** |
| **USD** | | | | |
| USD | ABIGROVE LTD-REG-S 0.50000% 16-29.04.21 | 6 000 000.00 | 5 762 146.29 | 0.75 |
| USD | AFRICAN MINERALS *DEFAULT* 8.50000% 12-10.02.17* | 8 800 000.00 | 78 305.75 | 0.01 |
| USD | APERAM-REG-S 0.62500% 14-08.07.21 | 7 200 000.00 | 7 897 704.22 | 1.02 |
| USD | HOLDGROVE LTD-REG-S 1.00000% 12-24.09.17 | 8 000 000.00 | 7 382 096.46 | 0.95 |
| USD | INMARSAT PLC-REG-S 3.87500% 16-09.09.23 | 8 600 000.00 | 7 687 885.75 | 0.99 |
| USD | POLARCUS LTD STEP-UP 16-30.12.22 | 2 760 000.00 | 221 035.77 | 0.03 |
| USD | POLARCUS LTD-144A-REG-S 5.60000% 11-30.03.22 | 6 440 000.00 | 2 607 403.45 | 0.34 |
| USD | PREMIER OIL FINANCE (JERSEY) LTD-REG-S 2.50000% 12-27.07.18 | 7 840 000.00 | 5 170 088.62 | 0.67 |
| USD | SIEMENS FINANCIRNGSMAATSCHAPIJ NV-REG-S 1.05000% 15-16.08.17 | 19 750 000.00 | 18 953 884.15 | 2.45 |
| USD | STMICROELECTRONICS NV-REG-S 1.00000% 14-03.07.21 | 8 600 000.00 | 7 790 660.26 | 1.01 |
| **Total USD** | | | **63 551 210.72** | **8.22** |
| **Total Wandelanleihen, fester Zins** | | | **443 090 506.26** | **57.34** |
| **Wandelanleihen, Nullcoupon** | | | | |
| **CHF** | | | | |
| CHF | BNP PARIBAS ARBITRAGE ISSUANCE BV 0.00000% 14-03.04.17 | 7 622 000.00 | 9 563 289.22 | 1.24 |
| CHF | GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL 0.00000% 15-26.02.18 | 16 485 000.00 | 15 184 982.13 | 1.96 |
| **Total CHF** | | | **24 748 271.35** | **3.20** |
| **EUR** | | | | |
| EUR | BUWOG AG 0.00000% 16-09.09.21 | 2 300 000.00 | 2 416 886.00 | 0.31 |
| EUR | EXANE SA 0.00000% 16-12.04.19 | 9 200 000.00 | 11 275 556.80 | 1.46 |
| EUR | FRESENIUS SE & CO KGAA-REG-S 0.00000% 14-24.09.19 | 7 800 000.00 | 11 401 962.00 | 1.48 |
| EUR | JP MORGAN STRUCTURED PRODUCTS BV-REG-S 0.00000% 14-25.09.17 | 14 230 000.00 | 14 790 676.23 | 1.91 |

* Siehe Erläuterung 8

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in EUR NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|
| EUR | NOMURA BANK INTERNATIONAL PLC-REG-S 0.00000% 15-26.02.18 | 13 900 000.00 | 14 503 260.00 | 1.88 |
| EUR | ORPAR SA-REG-S 0.00000% 15-15.07.19 | 7 500 000.00 | 7 782 750.00 | 1.01 |
| EUR | SG ISSUER-REG-S 0.00000% 15-05.03.18 | 14 770 000.00 | 15 344 553.00 | 1.99 |
| EUR | SOCIETE GENERALE SA 0.00000% 15-26.11.18 | 10 103 000.00 | 11 687 150.40 | 1.51 |
| **Total EUR** | | | **89 202 794.43** | **11.55** |
| **GBP** | | | | |
| GBP | BNP PARIBAS ARBITRAGE ISSUANCE BV-REG-S 0.00000% 15-19.03.18 | 10 900 000.00 | 12 755 537.32 | 1.65 |
| **Total GBP** | | | **12 755 537.32** | **1.65** |
| **SEK** | | | | |
| SEK | GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL 0.00000% 15-12.03.18 | 139 860 000.00 | 14 973 725.31 | 1.94 |
| **Total SEK** | | | **14 973 725.31** | **1.94** |
| **USD** | | | | |
| USD | STMICROELECTRONICS NV-REG-S 0.00000% 14-03.07.19 | 9 200 000.00 | 8 054 134.19 | 1.04 |
| **Total USD** | | | **8 054 134.19** | **1.04** |
| **Total Wandelanleihen, Nullcoupon** | | | **149 734 462.60** | **19.38** |
| **Wandelanleihen, variabler Zins** | | | | |
| **EUR** | | | | |
| EUR | AGEASFINLUX SA-REG-S-SUB 3M EURIBOR+135BP 02-PRP | 29 250 000.00 | 14 478 750.00 | 1.87 |
| EUR | BNP PARIBAS FORTIS SA-SUB 3M EURIBOR+200BP 07-PRP | 27 750 000.00 | 17 551 875.00 | 2.27 |
| EUR | NEOPOST SA-REG-S 3.375/VAR 15-PRP | 208 319.00 | 9 792 518.30 | 1.27 |
| EUR | OPUS SECURITIES SA 3.95000%/3M EURIBOR+300BP 06-PRP | 2 525 000.00 | 2 377 994.50 | 0.31 |
| **Total EUR** | | | **44 201 137.80** | **5.72** |
| **Total Wandelanleihen, variabler Zins** | | | **44 201 137.80** | **5.72** |
| **Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden** | | | **651 488 288.55** | **84.31** |

## Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Wandelanleihen, fester Zins** | | | | |
| **EUR** | | | | |
| EUR | FF GROUP FINANCE LUXEMBOURG-REG-S 1.75000% 14-03.07.19 | 8 500 000.00 | 7 618 295.00 | 0.98 |
| EUR | GLANBIA CO-OPERATIVE SOCIETY LTD-REG-S 1.37500% 16-09.06.21 | 7 400 000.00 | 7 704 806.00 | 1.00 |
| EUR | HUNGARIAN STATE HOLDING CO-REG-S 3.37500% 13-02.04.19 | 9 900 000.00 | 11 153 340.00 | 1.44 |
| **Total EUR** | | | **26 476 441.00** | **3.42** |
| **GBP** | | | | |
| GBP | CARILLION FINANCE JERSEY LTD-REG-S 2.50000% 14-19.12.19 | 6 500 000.00 | 7 226 713.36 | 0.94 |
| GBP | ST MODWEN PROPERTIES JERSEY LTD-REG-S 2.87500% 14-06.03.19 | 7 100 000.00 | 7 782 591.27 | 1.01 |
| GBP | UNITE JERSEY ISSUER LTD-REG-S 2.50000% 13-10.10.18 | 1 800 000.00 | 2 735 390.23 | 0.35 |
| **Total GBP** | | | **17 744 694.86** | **2.30** |
| **USD** | | | | |
| USD | TULLOW OIL JERSEY-REG-S 6.62500% 16-12.07.21 | 3 800 000.00 | 4 035 344.37 | 0.52 |
| USD | YANDEX NV 1.12500% 15-15.12.18 | 13 670 000.00 | 11 513 064.25 | 1.49 |
| **Total USD** | | | **15 548 408.62** | **2.01** |
| **Total Wandelanleihen, fester Zins** | | | **59 769 544.48** | **7.73** |
| **Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | **59 769 544.48** | **7.73** |
| **Total des Wertpapierbestandes** | | | **711 257 833.03** | **92.04** |

## Devisenterminkontrakte

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisenterminkontrakte (Kauf/Verkauf)** | | | | | | |
| EUR | 3 180 054.60 | GBP | 2 700 000.00 | 18.11.2016 | 63 092.67 | 0.01 |
| EUR | 75 823 191.00 | GBP | 63 500 000.00 | 21.10.2016 | 2 460 691.28 | 0.32 |
| EUR | 1 910 696.00 | GBP | 1 600 000.00 | 21.10.2016 | 62 192.07 | 0.01 |
| EUR | 13 791 239.68 | NOK | 128 000 000.00 | 18.11.2016 | -428 975.21 | -0.06 |
| EUR | 14 870 925.96 | SEK | 141 000 000.00 | 18.11.2016 | 224 296.29 | 0.03 |
| EUR | 6 924 408.25 | HUF | 2 150 000 000.00 | 18.11.2016 | -17 534.90 | 0.00 |
| EUR | 66 930 912.50 | CHF | 72 500 000.00 | 18.11.2016 | 339 934.00 | 0.04 |
| EUR | 2 811 088.80 | GBP | 2 400 000.00 | 21.10.2016 | 38 332.91 | 0.00 |
| CHF | 59 325 000.00 | EUR | 54 109 642.14 | 21.10.2016 | 358 020.00 | 0.05 |
| EUR | 273 981.11 | CHF | 300 000.00 | 21.10.2016 | -1 455.87 | 0.00 |
| EUR | 269 842.33 | CHF | 295 000.00 | 21.10.2016 | -1 004.03 | 0.00 |
| EUR | 3 117 303.00 | USD | 3 500 000.00 | 21.10.2016 | 5 772.21 | 0.00 |
| USD | 16 200 000.00 | EUR | 14 476 109.40 | 21.10.2016 | -74 166.87 | -0.01 |
| **Total Devisenterminkontrakte (Kauf/Verkauf)** | | | | | **3 029 194.55** | **0.39** |
| **Bankguthaben, Sicht- und Fristgelder und andere liquide Mittel** | | | | | **56 432 425.35** | **7.30** |
| **Andere Aktiva und Passiva** | | | | | **2 013 467.71** | **0.27** |
| **Total des Nettovermögens** | | | | | **772 732 920.64** | **100.00** |

# UBS (Lux) Bond Fund – EUR

## Wichtigste Daten

| | ISIN | 30.9.2016 | 31.3.2016 | 31.3.2015 |
|---|---|---|---|---|
| Nettovermögen in EUR | | 314 359 018.20 | 327 751 312.66 | 447 871 231.56 |
| **Klasse F-acc** | **LU0415166403** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 10 340.0070 | 11 403.0070 | 43 768.8250 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 416.75 | 405.12 | 404.56 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 416.75 | 405.12 | 404.56 |
| **Klasse F-dist[2]** | **LU0415166312** | | | |
| Anteile im Umlauf | | - | - | 17 795.0000 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | - | - | 144.41 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | - | - | 144.41 |
| **Klasse N-acc[3]** | **LU0168863511** | | | |
| Anteile im Umlauf | | - | - | 37 197.4770 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | - | - | 15.71 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | - | - | 15.71 |
| **Klasse P-acc** | **LU0033050237** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 516 839.7150 | 566 322.2390 | 788 258.3880 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 408.75 | 398.55 | 400.40 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 408.75 | 398.55 | 400.40 |
| **Klasse P-dist** | **LU0033049577** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 577 285.0620 | 586 043.4670 | 708 705.7850 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 140.12 | 139.01 | 142.56 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 140.12 | 139.01 | 142.56 |
| **Klasse Q-acc** | **LU0358407707** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 102 975.6060 | 97 128.4380 | 68 993.7570 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 154.17 | 150.02 | 150.12 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 154.17 | 150.02 | 150.12 |
| **Klasse Q-dist[4]** | **LU0415166585** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 19 325.4810 | 13 438.3730 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 104.88 | 103.11 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 104.88 | 103.11 | - |

[1] Siehe Erläuterung 1
[2] Für die Periode vom 9.7.2013 bis zum 15.9.2015 war die Anteilsklasse F-dist im Umlauf.
[3] Die Anteilsklasse N-acc war bis zum 22.2.2016 im Umlauf
[4] Erste NAV 2.10.2015

## Struktur des Wertpapierbestandes

| Geographische Aufteilung in % des Nettovermögens | |
|---|---|
| Frankreich | 17.24 |
| Deutschland | 16.68 |
| Spanien | 13.57 |
| Italien | 11.52 |
| Niederlande | 8.01 |
| Supranational | 4.89 |
| Belgien | 4.04 |
| Irland | 3.08 |
| Grossbritannien | 2.95 |
| Luxemburg | 2.83 |
| Vereinigte Staaten | 2.71 |
| Schweden | 1.64 |
| Australien | 1.60 |
| Japan | 1.20 |
| Schweiz | 1.16 |
| Norwegen | 1.13 |
| Kanada | 0.99 |
| Curaçao | 0.95 |
| Finnland | 0.93 |
| Slowenien | 0.30 |
| Mexiko | 0.29 |
| Jersey | 0.28 |
| **Total** | **97.99** |

| Wirtschaftliche Aufteilung in % des Nettovermögens | |
|---|---|
| Länder- & Zentralregierungen | 56.46 |
| Banken & Kreditinstitute | 13.51 |
| Finanz- & Beteiligungsgesellschaften | 7.89 |
| Supranationale Organisationen | 5.68 |
| Öffentlich-rechtliche Körperschaften | 2.27 |
| Kantone, Bundesstaaten | 1.59 |
| Anlagefonds | 1.58 |
| Pfandbriefinstitute & Refinanzierungsgesellschaften | 1.53 |
| Pharmazeutik, Kosmetik & medizinische Produkte | 1.49 |
| Fahrzeuge | 1.20 |
| Erdöl | 1.08 |
| Tabak & alkoholische Getränke | 0.89 |
| Elektrische Geräte & Komponenten | 0.80 |
| Chemie | 0.50 |
| Energie- & Wasserversorgung | 0.43 |
| Telekommunikation | 0.39 |
| Versicherungen | 0.35 |
| Computer & Netzwerkausrüster | 0.35 |
| **Total** | **97.99** |

## Nettovermögensaufstellung

| | | EUR |
|---|---|---|
| **Aktiva** | | **30.9.2016** |
| Wertpapierbestand, Einstandswert | 274 942 920.05 | |
| Wertpapierbestand, nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) | 33 103 558.87 | |
| Total Wertpapierbestand (Erläuterung 1) | | 308 046 478.92 |
| Bankguthaben, Sicht- und Fristgelder | | 1 475 932.77 |
| Andere liquide Mittel (Margins) | | 2 069 142.27 |
| Forderungen aus Zeichnungen | | 3 561 491.92 |
| Zinsforderungen aus Wertpapieren | | 3 707 610.00 |
| Nicht realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten (Erläuterung 1) | | -358 155.76 |
| Nicht realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Devisenterminkontrakten (Erläuterung 1) | | 1 073.98 |
| Nicht realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Swaps (Erläuterung 1) | | 579 018.31 |
| **Total Aktiva** | | **319 082 592.41** |
| | | |
| **Passiva** | | |
| Kontokorrentkredit | | -625 126.38 |
| Zinsverbindlichkeiten aus Kontokorrentkredit | | -177.49 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen (Erläuterung 1) | | -3 295 822.68 |
| Verbindlichkeiten aus Rücknahmen | | -648 714.09 |
| Rückstellungen für pauschale Verwaltungskommission (Erläuterung 2) | -111 214.95 | |
| Rückstellungen für Abonnementsabgabe (Erläuterung 3) | -38 248.87 | |
| Rückstellungen für sonstige Kommissionen und Gebühren (Erläuterung 2) | -4 269.75 | |
| Total Rückstellungen für Aufwendungen | | -153 733.57 |
| **Total Passiva** | | **-4 723 574.21** |
| | | |
| **Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode** | | **314 359 018.20** |

## Ertrags- und Aufwandsrechnung

| | EUR |
|---|---|
| **Erträge** | **1.4.2016-30.9.2016** |
| Zinsertrag auf liquide Mittel | 153.64 |
| Zinsen auf Wertpapiere | 3 955 556.06 |
| Erträge aus Securities Lending (Erläuterung 11) | 64 632.68 |
| **Total Erträge** | **4 020 342.38** |
| | |
| **Aufwendungen** | |
| Kosten aus Securities Lending (Erläuterung 11) | -25 853.07 |
| Pauschale Verwaltungskommission (Erläuterung 2) | -1 391 136.83 |
| Abonnementsabgabe (Erläuterung 3) | -77 027.30 |
| Sonstige Kommissionen und Gebühren (Erläuterung 2) | -21 608.01 |
| Zinsaufwand auf liquide Mittel und Kontokorrentkredit | -4 612.93 |
| **Total Aufwendungen** | **-1 520 238.14** |
| | |
| **Nettoerträge (-verluste) aus Anlagen** | **2 500 104.24** |
| | |
| **Realisierte Gewinne (Verluste) (Erläuterung 1)** | |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus marktbewerteten Wertpapieren ausser Optionen | 7 887 142.45 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Optionen | 29 482.49 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus renditebewerteten Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten | 8 009.19 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten | -1 428 376.47 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Devisenterminkontrakten | 230 643.72 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Swaps | -875 170.84 |
| Realisierter Währungsgewinn (-verlust) | -7 708.76 |
| **Total der realisierten Gewinne (Verluste)** | **5 844 021.78** |
| | |
| **Realisierter Nettogewinn (-verlust) der Berichtsperiode** | **8 344 126.02** |
| | |
| **Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung) (Erläuterung 1)** | |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) marktbewerteter Wertpapiere ausser Optionen | -1 064 266.60 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) renditebewerteter Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | -6 895.41 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) von Finanzterminkontrakten | 55 451.89 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) von Devisenterminkontrakten | -78 723.65 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) von Swaps | 792 730.43 |
| **Total der Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung)** | **-301 703.34** |
| | |
| **Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens infolge Geschäftstätigkeit** | **8 042 422.68** |

## Veränderungen des Nettovermögens

| | EUR |
|---|---|
| | **1.4.2016-30.9.2016** |
| Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode | 327 751 312.66 |
| Zeichnungen | 18 050 662.44 |
| Rücknahmen | -38 106 915.56 |
| Total Mittelzufluss (-abfluss) | -20 056 253.12 |
| Ausbezahlte Dividende | -1 378 464.02 |
| Nettoerträge (-verluste) aus Anlagen | 2 500 104.24 |
| Total der realisierten Gewinne (Verluste) | 5 844 021.78 |
| Total der Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung) | -301 703.34 |
| Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens infolge Geschäftstätigkeit | 8 042 422.68 |
| **Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode** | **314 359 018.20** |

## Entwicklung der Anteile im Umlauf

| | **1.4.2016-30.9.2016** |
|---|---|
| **Klasse** | **F-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 11 403.0070 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 384.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -1 447.0000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **10 340.0070** |
| **Klasse** | **P-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 566 322.2390 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 22 782.2620 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -72 264.7860 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **516 839.7150** |
| **Klasse** | **P-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 586 043.4670 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 38 360.6940 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -47 119.0990 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **577 285.0620** |
| **Klasse** | **Q-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 97 128.4380 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 14 359.8850 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -8 512.7170 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **102 975.6060** |
| **Klasse** | **Q-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 13 438.3730 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 11 552.2790 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -5 665.1710 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **19 325.4810** |

## Jährliche Ausschüttung

| UBS (Lux) Bond Fund | Ex-Date | Pay-Date | Währung | Betrag pro Anteil |
|---|---|---|---|---|
| – EUR P-dist | 1.6.2016 | 6.6.2016 | EUR | 2.39 |
| – EUR Q-dist | 1.6.2016 | 6.6.2016 | EUR | 1.05 |

# Aufstellung der Wertpapierbestände und anderer Nettovermögenswerte per 30. September 2016

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in EUR NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|
| **Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden** | | | | |
| **Notes, fester Zins** | | | | |
| **EUR** | | | | |
| EUR | FINLAND, REPUBLIC OF-144A-REG-S 1.50000% 13-15.04.23 | 2 600 000.00 | 2 908 568.00 | 0.93 |
| **Total EUR** | | | **2 908 568.00** | **0.93** |
| **USD** | | | | |
| USD | ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-REG-S 3.62500% 15-14.05.20 | 500 000.00 | 444 919.02 | 0.14 |
| **Total USD** | | | **444 919.02** | **0.14** |
| **Total Notes, fester Zins** | | | **3 353 487.02** | **1.07** |
| **Notes, variabler Zins** | | | | |
| **EUR** | | | | |
| EUR | CNP ASSURANCES-SUB 6.000%/VAR 10-14.09.40 | 1 000 000.00 | 1 111 140.00 | 0.35 |
| **Total EUR** | | | **1 111 140.00** | **0.35** |
| **Total Notes, variabler Zins** | | | **1 111 140.00** | **0.35** |
| **Medium-Term Notes, fester Zins** | | | | |
| **EUR** | | | | |
| EUR | AGENCE FRANCE LOCALE-REG-S 0.37500% 15-20.03.22 | 2 400 000.00 | 2 477 232.00 | 0.79 |
| EUR | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 4.00000% 10-26.04.18 | 1 000 000.00 | 1 063 360.00 | 0.34 |
| EUR | APPLE INC 1.00000% 14-10.11.22 | 500 000.00 | 525 135.00 | 0.17 |
| EUR | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 0.62500% 16-18.03.23 | 1 400 000.00 | 1 460 592.00 | 0.46 |
| EUR | BANK OF AMERICA CORP-REG-S 2.50000% 13-27.07.20 | 2 000 000.00 | 2 176 500.00 | 0.69 |
| EUR | BANK OF IRELAND MORTGAGE BANK 3.62500% 13-02.10.20 | 2 300 000.00 | 2 642 585.00 | 0.84 |
| EUR | BP CAPITAL MARKETS PLC 2.17700% 14-28.09.21 | 1 110 000.00 | 1 217 436.90 | 0.39 |
| EUR | COCA-COLA HBC FINANCE BV 2.37500% 13-18.06.20 | 1 900 000.00 | 2 045 882.00 | 0.65 |
| EUR | COMPAGNIE DE FINANCEMENT FONCIER 2.00000% 14-07.05.24 | 2 300 000.00 | 2 660 778.00 | 0.85 |
| EUR | DNB BOLIGKREDITT AS 3.87500% 11-16.06.21 | 500 000.00 | 595 840.00 | 0.19 |
| EUR | EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 1.25000% 13-05.02.18 | 1 900 000.00 | 1 942 389.00 | 0.62 |
| EUR | EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 1.87500% 13-23.05.23 | 1 450 000.00 | 1 664 600.00 | 0.53 |
| EUR | EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FAC-REG-S 0.20000% 15-28.04.25 | 2 400 000.00 | 2 461 560.00 | 0.78 |
| EUR | EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.62500% 11-15.01.21 | 4 300 000.00 | 5 057 660.00 | 1.61 |
| EUR | EUROPEAN UNION-REG-S 2.50000% 12-04.11.27 | 2 650 000.00 | 3 343 584.50 | 1.06 |
| EUR | FCE BANK PLC-REG-S 1.75000% 13-21.05.18 | 1 000 000.00 | 1 027 930.00 | 0.33 |
| EUR | FMS WERTMANAGEMENT 0.37500% 15-29.04.30 | 3 900 000.00 | 3 884 595.00 | 1.24 |
| EUR | GAZ CAPITAL SA/GAZPROM LPN 6.60500% 07-13.02.18 | 1 100 000.00 | 1 175 878.00 | 0.37 |
| EUR | GE CAPITAL EUROPEAN FUNDING 4.62500% 07-22.02.27 | 1 500 000.00 | 2 101 957.50 | 0.67 |
| EUR | GLAXOSMITHKLINE CAPITAL PLC-REG-S 0.62500% 14-02.12.19 | 1 900 000.00 | 1 938 304.00 | 0.62 |
| EUR | GLENCORE FINANCE EUROPE SA-REG-S 1.87500% 16-13.09.23 | 300 000.00 | 297 150.00 | 0.09 |
| EUR | HSBC FRANCE 1.87500% 13-16.01.20 | 1 800 000.00 | 1 907 100.00 | 0.61 |
| EUR | KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 0.37500% 15-23.04.30 | 4 900 000.00 | 4 935 427.00 | 1.57 |
| EUR | KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 1.25000% 12-17.10.19 | 3 500 000.00 | 3 685 185.00 | 1.17 |
| EUR | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 1.87500% 12-13.01.23 | 1 000 000.00 | 1 117 430.00 | 0.36 |
| EUR | ONTARIO, PROVINCE OF 4.00000% 09-03.12.19 | 2 000 000.00 | 2 272 780.00 | 0.72 |
| EUR | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 2.87500% 14-03.03.26 | 1 450 000.00 | 1 736 128.50 | 0.55 |
| EUR | RABOBANK INTERNATIONAL 4.00000% 12-11.01.22 | 3 400 000.00 | 4 078 980.00 | 1.30 |
| EUR | ROBERT BOSCH GMBH-REG-S 1.75000% 14-08.07.24 | 2 300 000.00 | 2 529 218.00 | 0.80 |
| EUR | ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC-REG-S 2.50000% 16-22.03.23 | 1 500 000.00 | 1 517 400.00 | 0.48 |
| EUR | SANOFI-REG-S 1.75000% 14-10.09.26 | 1 500 000.00 | 1 681 110.00 | 0.54 |
| EUR | SANTANDER UK PLC-REG-S 2.62500% 13-16.07.20 | 2 600 000.00 | 2 822 612.00 | 0.90 |
| EUR | SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 1.87500% 15-15.09.25 | 1 000 000.00 | 1 126 370.00 | 0.36 |
| EUR | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 1.62500% 13-04.11.20 | 650 000.00 | 700 232.00 | 0.22 |
| EUR | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 0.62500% 15-30.01.23 | 1 660 000.00 | 1 736 808.20 | 0.55 |
| EUR | SLOVENIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.37500% 11-18.01.21 | 800 000.00 | 948 800.00 | 0.30 |
| EUR | SPAREBANKEN 1 BOLIGKREDITT-REG-S 0.75000% 15-05.09.22 | 1 200 000.00 | 1 260 924.00 | 0.40 |
| EUR | STOCKHOLMS LANS LANDSTING 2.12500% 12-12.09.22 | 2 400 000.00 | 2 710 752.00 | 0.86 |
| EUR | TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE IV BV 2.87500% 12-15.04.19 | 2 800 000.00 | 2 994 572.00 | 0.95 |
| EUR | TOYOTA MOTOR CORP-REG-S 2.37500% 13-01.02.23 | 3 300 000.00 | 3 768 798.00 | 1.20 |
| EUR | UBS GROUP FUNDING JERSEY LTD-REG-S 1.25000% 16-01.09.26 | 900 000.00 | 893 493.00 | 0.28 |
| EUR | VODAFONE GROUP PLC-REG-S 1.60000% 16-29.07.31 | 300 000.00 | 303 996.00 | 0.10 |
| EUR | WESTPAC BANKING CORP-REG-S 1.37500% 13-17.04.20 | 1 900 000.00 | 2 006 324.00 | 0.64 |
| **Total EUR** | | | **88 495 388.60** | **28.15** |
| **Total Medium-Term Notes, fester Zins** | | | **88 495 388.60** | **28.15** |
| **Medium-Term Notes, variabler Zins** | | | | |
| **EUR** | | | | |
| EUR | DNB BANK ASA-REG-S-SUB 3.000%/12M EUSA5+177BP 13-26.09.23 | 1 620 000.00 | 1 689 935.40 | 0.54 |
| EUR | ING BANK NV-REG-S-SUB 3.000%/VAR 16-11.04.28 | 600 000.00 | 636 078.00 | 0.20 |
| EUR | TOTAL SA-REG-S-SUB 2.250%/VAR 15-PRP | 1 500 000.00 | 1 486 125.00 | 0.47 |
| **Total EUR** | | | **3 812 138.40** | **1.21** |
| **Total Medium-Term Notes, variabler Zins** | | | **3 812 138.40** | **1.21** |
| **Anleihen, fester Zins** | | | | |
| **EUR** | | | | |
| EUR | AMERICA MOVIL SAB DE CV 1.00000% 14-04.06.18 | 900 000.00 | 912 834.00 | 0.29 |
| EUR | APPLE INC 2.00000% 15-17.09.27 | 500 000.00 | 567 495.00 | 0.18 |
| EUR | BANKIA SA-REG-S 1.12500% 15-05.08.22 | 2 900 000.00 | 3 097 171.00 | 0.98 |
| EUR | BELGIUM, KINGDOM OF 4.50000% 11-28.03.26 | 6 460 000.00 | 9 212 153.80 | 2.93 |
| EUR | BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.90000% 15-22.06.38 | 2 000 000.00 | 2 437 680.00 | 0.78 |
| EUR | CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SOCIALE 4.00000% 12-15.12.25 | 2 400 000.00 | 3 267 600.00 | 1.04 |

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in EUR NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|
| EUR | CREDIT SUISSE GUERNSEY LTD-REG-S 0.75000% 14-17.09.21 | 3 500 000.00 | 3 643 885.00 | 1.16 |
| EUR | EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.00000% 16-14.04.32 | 3 100 000.00 | 3 379 031.00 | 1.07 |
| EUR | FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 5.75000% 01-25.10.32 | 5 500 000.00 | 9 958 250.50 | 3.17 |
| EUR | FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 8.25000% 92-25.04.22 | 6 300 000.00 | 9 369 045.00 | 2.98 |
| EUR | FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 4.00000% 06-25.10.38 | 2 885 000.00 | 4 769 453.15 | 1.52 |
| EUR | FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 3.50000% 10-25.04.20 | 7 400 000.00 | 8 479 586.00 | 2.70 |
| EUR | FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 4.00000% 10-25.04.60 | 1 000 000.00 | 1 957 680.00 | 0.62 |
| EUR | FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 1.00000% 15-25.11.25 | 3 400 000.00 | 3 698 996.00 | 1.18 |
| EUR | GERMAN POSTAL PENSIONS SEC 3.75000% 05-18.01.21 | 1 800 000.00 | 2 103 003.00 | 0.67 |
| EUR | GERMANY, REPUBLIC OF 1.50000% 14-15.05.24 | 1 000 000.00 | 1 147 828.00 | 0.36 |
| EUR | GERMANY, REPUBLIC OF 5.50000% 00-04.01.31 | 3 300 000.00 | 5 870 822.10 | 1.87 |
| EUR | GERMANY, REPUBLIC OF 4.75000% 03-04.07.34 | 1 800 000.00 | 3 254 400.00 | 1.03 |
| EUR | GERMANY, REPUBLIC OF 4.00000% 05-04.01.37 | 2 900 000.00 | 5 053 192.00 | 1.61 |
| EUR | GERMANY, REPUBLIC OF 4.25000% 07-04.07.39 | 4 700 000.00 | 8 767 530.41 | 2.79 |
| EUR | GERMANY, REPUBLIC OF 2.50000% 12-04.07.44 | 7 580 000.00 | 11 722 697.40 | 3.73 |
| EUR | IRELAND, REPUBLIC OF 4.50000% 04-18.04.20 | 2 400 000.00 | 2 820 960.00 | 0.90 |
| EUR | ITALY, REPUBLIC OF 3.75000% 06-01.08.21 | 8 750 000.00 | 10 213 875.00 | 3.25 |
| EUR | ITALY, REPUBLIC OF-BTP 4.00000% 05-01.02.37 | 3 450 000.00 | 4 681 305.00 | 1.49 |
| EUR | ITALY, REPUBLIC OF-BTP 4.75000% 08-01.08.23 | 2 850 000.00 | 3 635 602.50 | 1.16 |
| EUR | ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 3.50000% 14-01.03.30 | 4 300 000.00 | 5 363 605.00 | 1.71 |
| EUR | ITALY, REPUBLIC OF-BTP 1.50000% 14-01.08.19 | 4 800 000.00 | 5 003 520.00 | 1.59 |
| EUR | ITALY, REPUBLIC OF-BTP-144A-REG-S 3.250% 14-01.09.46 | 441 000.00 | 542 518.20 | 0.17 |
| EUR | ITALY, REPUBLIC OF-BTP 1.35000% 15-15.04.22 | 1 500 000.00 | 1 575 450.00 | 0.50 |
| EUR | ITALY, REPUBLIC OF-BTP 1.60000% 16-01.06.26 | 5 000 000.00 | 5 189 000.00 | 1.65 |
| EUR | NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 5.50000% 98-15.01.28 | 4 244 253.00 | 6 875 795.97 | 2.19 |
| EUR | NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 3.25000% 11-15.07.21 | 3 300 000.00 | 3 907 430.99 | 1.24 |
| EUR | RABOBANK NEDERLAND NV-SUB 3.87500% 13-25.07.23 | 3 000 000.00 | 3 482 160.00 | 1.11 |
| EUR | ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 1.25000% 13-29.10.18 | 800 000.00 | 824 992.00 | 0.26 |
| EUR | SPAIN GOVERNMENT BOND-144A-REG-S 2.75000% 14-31.10.24 | 5 780 000.00 | 6 736 301.00 | 2.14 |
| EUR | SPAIN, KINGDOM OF 4.00000% 10-30.04.20 | 7 800 000.00 | 8 929 440.00 | 2.84 |
| EUR | SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 5.15000% 13-31.10.44 | 5 700 000.00 | 9 673 185.00 | 3.08 |
| EUR | SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 3.80000% 14-30.04.24 | 3 000 000.00 | 3 718 500.00 | 1.18 |
| EUR | SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.95000% 16-30.04.26 | 8 250 000.00 | 9 056 437.50 | 2.88 |
| EUR | TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.62500% 16-15.10.28 | 400 000.00 | 406 264.00 | 0.13 |
| EUR | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FIN NV 2.00000% 13-14.01.20 | 900 000.00 | 952 488.00 | 0.30 |
| **Total EUR** | | | **196 259 163.52** | **62.43** |
| **USD** | | | | |
| USD | SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 3.25000% 15-11.05.25 | 1 000 000.00 | 937 420.36 | 0.30 |
| **Total USD** | | | **937 420.36** | **0.30** |
| **Total Anleihen, fester Zins** | | | **197 196 583.88** | **62.73** |
| **Anleihen, variabler Zins** | | | | |
| **EUR** | | | | |
| EUR | BAYER AG-REG-S-SUB 2.375%/VAR 15-02.04.75 | 1 650 000.00 | 1 579 990.50 | 0.50 |
| EUR | ENGIE SA REG-S-SUB 3.875%/VAR 13-PRP | 1 300 000.00 | 1 358 890.00 | 0.43 |
| EUR | JPMORGAN CHASE BANK-SUB 4.37500%/1M EURIBOR+90BP 06-30.11.21 | 3 500 000.00 | 3 506 426.00 | 1.12 |
| EUR | ORIGIN ENERGY FINANCE LTD-REG-S-SUB 4.000%/VAR 14-16.09.74 | 2 000 000.00 | 1 914 840.00 | 0.61 |
| EUR | RABOBANK NEDERLAND NV REG-S 5.500%/VAR 15-PRP | 750 000.00 | 740 640.00 | 0.24 |
| **Total EUR** | | | **9 100 786.50** | **2.90** |
| **Total Anleihen, variabler Zins** | | | **9 100 786.50** | **2.90** |
| **Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden** | | | **303 069 524.40** | **96.41** |

## OGAW/Andere OGA im Sinne des Artikels 41 (1) e) des abgeänderten luxemburgischen Gesetzes vom 17. Dezember 2010

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Investment Fonds, open end** | | | | |
| **Luxemburg** | | | | |
| EUR | UBS (LUX) BOND SICAV - EUR INFLATION-LINKED (EUR) U-X-ACC | 378.11 | 4 976 954.52 | 1.58 |
| **Total Luxemburg** | | | **4 976 954.52** | **1.58** |
| **Total Investment Fonds, open end** | | | **4 976 954.52** | **1.58** |
| **Total OGAW/Andere OGA im Sinne des Artikels 41 (1) e) des abgeänderten luxemburgischen Gesetzes vom 17. Dezember 2010** | | | **4 976 954.52** | **1.58** |
| **Total des Wertpapierbestandes** | | | **308 046 478.92** | **97.99** |

# Derivative Instrumente

## Derivative Instrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Financial Futures auf Anleihen** | | | | |
| USD | US LONG BOND FUTURE 21.12.16 | 75.00 | 31 283.37 | 0.01 |
| USD | US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.12.16 | -147.00 | -20 439.13 | -0.01 |
| EUR | EURO-BUND FUTURE 08.12.16 | -80.00 | -111 620.00 | -0.03 |
| EUR | EURO-BUXL FUTURE 08.12.16 | -106.00 | -288 880.00 | -0.09 |
| EUR | EURO-BOBL FUTURE 08.12.16 | 70.00 | 31 500.00 | 0.01 |
| **Total Financial Futures auf Anleihen** | | | **-358 155.76** | **-0.11** |
| **Total Derivative Instrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden** | | | **-358 155.76** | **-0.11** |

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in EUR NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|

## Derivative Instrumente, die nicht an einer offiziellen Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

**Swaps und Forward-Swaps auf Zinssätze**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| USD | LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 1.40700% 16-01.02.21 | -18 600 000.00 | -208 823.06 | -0.06 |
| USD | LCH/INTEREST RATE SWAP REC 3ML 16-01.02.21 | | | |
| JPY | LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 0.53750% 16-14.04.46 | -279 000 000.00 | -56 508.60 | -0.02 |
| JPY | LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6ML 16-14.04.46 | | | |
| JPY | LCH/INTEREST RATE SWAP REC 0.09000% 16-14.04.26 | 803 000 000.00 | 41 902.19 | 0.01 |
| JPY | LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 6ML 16-14.04.26 | | | |
| **Total Swaps und Forward-Swaps auf Zinssätze** | | | **-223 429.47** | **-0.07** |

**Credit-Default-Swaps***

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| EUR | ICE/ITRX EUXOVER 25 | 10 000 000.00 | 802 447.78 | 0.25 |
| **Total Credit-Default-Swaps** | | | **802 447.78** | **0.25** |

| | | |
|---|---|---|
| **Total Derivative Instrumente, die nicht an einer offiziellen Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | **579 018.31** | **0.18** |
| **Total Derivative Instrumente** | **220 862.55** | **0.07** |

## Devisenterminkontrakte

**Devisenterminkontrakte (Kauf/Verkauf)**

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| AUD | 2 500 000.00 | NZD | 2 631 302.50 | 4.11.2016 | 708.54 | 0.00 |
| EUR | 2 600 000.00 | USD | 2 926 245.40 | 4.11.2016 | 365.44 | 0.00 |
| **Total Devisenterminkontrakte (Kauf/Verkauf)** | | | | | **1 073.98** | **0.00** |

| | | |
|---|---|---|
| **Bankguthaben, Sicht- und Fristgelder und andere liquide Mittel** | **3 545 075.04** | **1.13** |
| **Kontokorrentkredit und andere kurzfristige Verbindlichkeiten** | **-625 126.38** | **-0.20** |
| **Andere Aktiva und Passiva** | **3 170 654.09** | **1.01** |
| **Total des Nettovermögens** | **314 359 018.20** | **100.00** |

* Nominal positiv: der Subfonds ist «Receiver», Nominal negativ: der Subfonds ist «Payer».

# UBS (Lux) Bond Fund – Euro High Yield (EUR)

## Wichtigste Daten

| | ISIN | 30.9.2016 | 31.3.2016 | 31.3.2015 |
|---|---|---|---|---|
| Nettovermögen in EUR | | 3 519 316 158.24 | 4 366 033 538.56 | 5 761 737 193.69 |
| **Klasse F-acc** | **LU0415181469** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 37 422.0770 | 118 198.9290 | 147 505.0690 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 194.53 | 184.40 | 186.91 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 194.53 | 184.40 | 186.91 |
| **Klasse I-A1-acc** | **LU0415181899** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 322 095.0550 | 402 011.9800 | 333 364.2070 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 129.73 | 123.04 | 124.84 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 129.73 | 123.04 | 124.84 |
| **Klasse I-A2-acc[2]** | **LU1368322555** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 76 604.4260 | - | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 105.36 | - | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 105.36 | - | - |
| **Klasse I-B-acc** | **LU0415182517** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 63 361.8800 | 45 471.9960 | 35 800.9580 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 189.56 | 179.28 | 180.90 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 189.56 | 179.28 | 180.90 |
| **Klasse I-B-mdist** | **LU0908558249** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 400 323.2070 | 466 097.0290 | 744 345.7180 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 99.75 | 96.70 | 102.84 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 99.75 | 96.70 | 102.84 |
| **Klasse I-X-acc** | **LU0415182780** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 3 020 964.1910 | 4 844 509.7710 | 4 056 728.0210 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 113.03 | 106.86 | 107.75 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 113.03 | 106.86 | 107.75 |
| **Klasse (CHF hedged) I-X-acc[3]** | **LU0654646750** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 9 100.0000 | - | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 104.04 | - | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF[1] | | 104.04 | - | - |
| **Klasse (USD hedged) K-1-6%-mdist[4]** | **LU1230129923** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 1.2000 | 1.2000 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in USD | | 4 833 990.42 | 4 697 161.59 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in USD[1] | | 4 833 990.42 | 4 697 161.59 | - |
| **Klasse K-1-acc** | **LU0415180909** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 8.7000 | 9.7000 | 9.7000 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 5 107 296.54 | 4 846 745.96 | 4 923 665.52 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 5 107 296.54 | 4 846 745.96 | 4 923 665.52 |
| **Klasse (USD hedged) K-1-acc** | **LU1004765761** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 1.3000 | 3.1000 | 4.0000 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in USD | | 5 599 166.88 | 5 278 743.64 | 5 332 152.82 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in USD[1] | | 5 599 166.88 | 5 278 743.64 | 5 332 152.82 |
| **Klasse (RMB hedged) K-1-mdist[5]** | **LU1030385881** | | | |
| Anteile im Umlauf | | - | - | 4.1000 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CNH | | - | - | 35 110 831.26 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CNH[1] | | - | - | 35 110 831.26 |
| **Klasse (USD hedged) K-1-mdist[6]** | **LU1329801796** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 3.9000 | 3.9000 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in USD | | 5 104 971.17 | 4 965 710.76 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in USD[1] | | 5 104 971.17 | 4 965 710.76 | - |
| **Klasse N-dist** | **LU0415180495** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 102 472.5960 | 114 834.2470 | 122 298.8940 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 102.82 | 101.51 | 108.14 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 102.82 | 101.51 | 108.14 |
| **Klasse P-6%-mdist** | **LU1076698254** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 186 320.2930 | 161 657.1810 | 53 485.0100 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 91.96 | 90.19 | 97.90 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 91.96 | 90.19 | 97.90 |
| **Klasse P-acc** | **LU0086177085** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 2 694 875.8700 | 3 358 637.9870 | 4 186 700.9740 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 189.69 | 180.52 | 184.41 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 189.69 | 180.52 | 184.41 |

[1] Siehe Erläuterung 1
[2] Erste NAV 12.4.2016
[3] Erste NAV 23.5.2016
[4] Erste NAV 20.5.2015
[5] Die Anteilsklasse (RMB hedged) K-1-mdist war bis zum 27.8.2015 im Umlauf
[6] Erste NAV 15.12.2015

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Klasse (CHF hedged) P-acc** | **LU0776290842** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 262 183.4660 | 321 460.5280 | 267 187.8370 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 139.06 | 132.69 | 136.59 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF[1] | | 139.06 | 132.69 | 136.59 |
| **Klasse (USD hedged) P-acc** | **LU0994471687** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 1 382 865.7390 | 2 626 077.5890 | 1 584 660.5300 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in USD | | 112.30 | 106.18 | 107.86 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in USD[1] | | 112.30 | 106.18 | 107.86 |
| **Klasse P-dist** | **LU0085995990** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 4 643 593.4360 | 5 010 671.2870 | 4 489 469.9950 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 48.67 | 48.18 | 51.33 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 48.67 | 48.18 | 51.33 |
| **Klasse P-mdist** | **LU0417441200** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 1 929 795.5350 | 2 380 461.8480 | 3 394 980.9240 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 136.76 | 133.88 | 145.18 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 136.76 | 133.88 | 145.18 |
| **Klasse (JPY) P-mdist[7]** | **LU1318703292** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 685.9620 | 685.9620 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in JPY | | 9 084.00 | 10 034.00 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in JPY[1] | | 9 084.00 | 10 034.00 | - |
| **Klasse (AUD hedged) P-mdist** | **LU0945635778** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 2 512 654.5350 | 3 093 986.2980 | 4 229 217.5600 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in AUD | | 96.41 | 94.39 | 102.62 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in AUD[1] | | 96.41 | 94.39 | 102.62 |
| **Klasse (CAD hedged) P-mdist** | **LU0945635851** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 659 023.0990 | 806 325.3830 | 938 283.2970 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CAD | | 96.90 | 94.69 | 102.84 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CAD[1] | | 96.90 | 94.69 | 102.84 |
| **Klasse (GBP hedged) P-mdist** | **LU0997192736** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 284 115.1770 | 366 377.4910 | 363 564.4610 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in GBP | | 93.48 | 91.36 | 98.81 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in GBP[1] | | 93.48 | 91.36 | 98.81 |
| **Klasse (HKD hedged) P-mdist** | **LU0973218331** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 587 847.9830 | 906 703.8490 | 1 648 901.0740 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in HKD | | 944.17 | 922.94 | 1 000.30 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in HKD[1] | | 944.17 | 922.94 | 1 000.30 |
| **Klasse (RMB hedged) P-mdist** | **LU0968750884** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 269 758.1360 | 388 395.1700 | 1 044 694.3200 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CNH | | 1 003.28 | 975.83 | 1 025.96 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CNH[1] | | 1 003.28 | 975.83 | 1 025.96 |
| **Klasse (SGD hedged) P-mdist** | **LU0989134753** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 2 502 884.8730 | 3 422 238.0850 | 4 997 588.2970 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in SGD | | 94.97 | 92.62 | 99.36 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in SGD[1] | | 94.97 | 92.62 | 99.36 |
| **Klasse (USD hedged) P-mdist** | **LU0937166394** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 9 921 221.9930 | 14 314 911.6670 | 21 045 816.6160 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in USD | | 95.10 | 92.77 | 100.56 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in USD[1] | | 95.10 | 92.77 | 100.56 |
| **Klasse Q-6%-mdist[8]** | **LU1240770286** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 8 641.8540 | 2 310.5520 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 101.19 | 98.96 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 101.19 | 98.96 | - |
| **Klasse (USD hedged) Q-6%-mdist[9]** | **LU1317082110** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 174 550.9030 | 172 975.9030 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in USD | | 101.19 | 98.34 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in USD[1] | | 101.19 | 98.34 | - |
| **Klasse Q-acc** | **LU0358408267** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 1 897 361.0660 | 1 487 934.5810 | 1 693 392.0420 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 171.09 | 162.38 | 164.99 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 171.09 | 162.38 | 164.99 |
| **Klasse (CHF hedged) Q-acc[10]** | **LU1240769437** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 707 621.2290 | 596 720.6120 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 104.10 | 99.06 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF[1] | | 104.10 | 99.06 | - |
| **Klasse (USD hedged) Q-acc[10]** | **LU1240770013** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 199 247.6290 | 202 405.9430 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in USD | | 105.91 | 99.87 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in USD[1] | | 105.91 | 99.87 | - |
| **Klasse Q-dist[8]** | **LU0415181543** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 139 731.2280 | 129 821.6860 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 102.18 | 99.43 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 102.18 | 99.43 | - |

[1] Siehe Erläuterung 1
[7] Erste NAV 8.1.2016
[8] Erste NAV 4.9.2015
[9] Erste NAV 13.11.2015
[10] Erste NAV 7.9.2015

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Klasse Q-mdist[11]** | **LU1240770369** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 93 943.1050 | 95 299.3770 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 101.01 | 98.61 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 101.01 | 98.61 | - |
| **Klasse (GBP hedged) Q-mdist[12]** | **LU1240769510** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 6 958.5250 | 1 951.4420 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in GBP | | 100.37 | 97.84 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in GBP[1] | | 100.37 | 97.84 | - |
| **Klasse (USD hedged) Q-mdist[11]** | **LU1240770104** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 89 670.2450 | 42 006.6990 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in USD | | 101.52 | 98.74 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in USD[1] | | 101.52 | 98.74 | - |

[1] Siehe Erläuterung 1
[11] Erste NAV 20.10.2015
[12] Erste NAV 16.11.2015

## Struktur des Wertpapierbestandes

| **Geographische Aufteilung in % des Nettovermögens** | |
|---|---|
| Luxemburg | 17.77 |
| Grossbritannien | 15.08 |
| Frankreich | 12.01 |
| Vereinigte Staaten | 11.45 |
| Italien | 7.90 |
| Irland | 6.81 |
| Niederlande | 6.33 |
| Deutschland | 5.88 |
| Jersey | 2.51 |
| Spanien | 1.53 |
| Österreich | 1.29 |
| Kanada | 1.22 |
| Schweiz | 1.07 |
| Japan | 0.96 |
| Australien | 0.85 |
| Schweden | 0.77 |
| Cayman-Inseln | 0.64 |
| Norwegen | 0.46 |
| Belgien | 0.46 |
| Mexiko | 0.39 |
| Kroatien | 0.38 |
| Dänemark | 0.37 |
| Brasilien | 0.28 |
| Portugal | 0.28 |
| Finnland | 0.03 |
| **Total** | **96.72** |

| **Wirtschaftliche Aufteilung in % des Nettovermögens** | |
|---|---|
| Finanz- & Beteiligungsgesellschaften | 34.94 |
| Banken & Kreditinstitute | 12.36 |
| Telekommunikation | 7.95 |
| Diverse nicht klassierte Gesellschaften | 3.83 |
| Pfandbriefinstitute & Refinanzierungsgesellschaften | 3.14 |
| Anlagefonds | 2.84 |
| Diverse Dienstleistungen | 2.63 |
| Verpackungsindustrie | 2.62 |
| Chemie | 2.41 |
| Detailhandel, Warenhäuser | 2.33 |
| Internet, Software & IT-Dienste | 2.13 |
| Energie- & Wasserversorgung | 2.04 |
| Versicherungen | 1.86 |
| Bergbau, Kohle & Stahl | 1.74 |
| Gesundheits- & Sozialwesen | 1.64 |
| Erdöl | 1.61 |
| Baugewerbe & Baumaterial | 1.61 |
| Fahrzeuge | 1.29 |
| Pharmazeutik, Kosmetik & medizinische Produkte | 1.25 |
| Verkehr & Transport | 0.99 |
| Elektrische Geräte & Komponenten | 0.93 |
| Immobilien | 0.83 |
| Nahrungsmittel & Softdrinks | 0.73 |
| Gastgewerbe & Freizeit | 0.61 |
| Computer & Netzwerkausrüster | 0.48 |
| Maschinen & Apparate | 0.43 |
| Flugzeug- & Raumfahrtindustrie | 0.34 |
| Textilien, Kleidung & Lederwaren | 0.29 |
| Elektronik & Halbleiter | 0.27 |
| Gummi & Reifen | 0.25 |
| Nichteisenmetalle | 0.19 |
| Diverse Konsumgüter | 0.16 |
| **Total** | **96.72** |

## Nettovermögensaufstellung

| | | EUR |
|---|---|---|
| **Aktiva** | | **30.9.2016** |
| Wertpapierbestand, Einstandswert | 3 363 935 326.34 | |
| Wertpapierbestand, nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) | 40 083 925.82 | |
| Total Wertpapierbestand (Erläuterung 1) | | 3 404 019 252.16 |
| Bankguthaben, Sicht- und Fristgelder | | 80 446 476.13* |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen (Erläuterung 1) | | 13 174 393.87 |
| Forderungen aus Zeichnungen | | 6 940 415.14 |
| Zinsforderungen aus Wertpapieren | | 56 914 059.66 |
| Zinsforderungen aus liquiden Mitteln | | 12 764.84 |
| Nicht realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Devisenterminkontrakten (Erläuterung 1) | | 8 902 342.56 |
| Nicht realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Swaps (Erläuterung 1) | | -2 319 122.10 |
| **Total Aktiva** | | **3 568 090 582.26** |
| | | |
| **Passiva** | | |
| Zinsverbindlichkeiten aus Kontokorrentkredit | | -33 352.78 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen (Erläuterung 1) | | -24 651 814.29 |
| Verbindlichkeiten aus Rücknahmen | | -22 153 048.31 |
| Rückstellungen für pauschale Verwaltungskommission (Erläuterung 2) | -1 504 401.94 | |
| Rückstellungen für Abonnementsabgabe (Erläuterung 3) | -394 776.27 | |
| Rückstellungen für sonstige Kommissionen und Gebühren (Erläuterung 2) | -37 030.43 | |
| Total Rückstellungen für Aufwendungen | | -1 936 208.64 |
| **Total Passiva** | | **-48 774 424.02** |
| | | |
| **Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode** | | **3 519 316 158.24** |

## Ertrags- und Aufwandsrechnung

| | EUR |
|---|---|
| **Erträge** | **1.4.2016-30.9.2016** |
| Zinsertrag auf liquide Mittel | 60 488.12 |
| Zinsen auf Wertpapiere | 103 457 097.19 |
| Dividenden | 235 943.37 |
| Erträge aus Securities Lending (Erläuterung 11) | 36 030.57 |
| Sonstige Erträge | 2 374 301.51 |
| **Total Erträge** | **106 163 860.76** |
| | |
| **Aufwendungen** | |
| Kosten aus Securities Lending (Erläuterung 11) | -14 412.23 |
| Pauschale Verwaltungskommission (Erläuterung 2) | -20 720 118.31 |
| Abonnementsabgabe (Erläuterung 3) | -843 538.26 |
| Sonstige Kommissionen und Gebühren (Erläuterung 2) | -200 329.58 |
| Zinsaufwand auf liquide Mittel und Kontokorrentkredit | -96 229.69 |
| **Total Aufwendungen** | **-21 874 628.07** |
| | |
| **Nettoerträge (-verluste) aus Anlagen** | **84 289 232.69** |
| | |
| **Realisierte Gewinne (Verluste) (Erläuterung 1)** | |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus marktbewerteten Wertpapieren ausser Optionen | -26 273 709.62 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Optionen | -2 551 250.00 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Devisenterminkontrakten | -6 919 007.68 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Swaps | -23 346 335.57 |
| Realisierter Währungsgewinn (-verlust) | 24 445 764.32 |
| **Total der realisierten Gewinne (Verluste)** | **-34 644 538.55** |
| | |
| **Realisierter Nettogewinn (-verlust) der Berichtsperiode** | **49 644 694.14** |
| | |
| **Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung) (Erläuterung 1)** | |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) marktbewerteter Wertpapiere ausser Optionen | 136 366 231.88 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) von Devisenterminkontrakten | 36 193 443.86 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) von Swaps | 19 950 403.63 |
| **Total der Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung)** | **192 510 079.37** |
| | |
| **Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens infolge Geschäftstätigkeit** | **242 154 773.51** |

* Zum 30. September 2016 wurden gegenüber JP Morgan Chase London Bankguthaben in Höhe von EUR 1 700 000 und Merill Lynch Bankguthaben in Höhe von EUR 700 000 als Sicherheit eingesetzt.

## Veränderungen des Nettovermögens

| | EUR |
|---|---|
| | **1.4.2016-30.9.2016** |
| Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode | 4 366 033 538.56 |
| Zeichnungen | 639 316 675.94 |
| Rücknahmen | -1 654 176 677.51 |
| Total Mittelzufluss (-abfluss) | -1 014 860 001.57 |
| Ausbezahlte Dividende | -74 012 152.26 |
| Nettoerträge (-verluste) aus Anlagen | 84 289 232.69 |
| Total der realisierten Gewinne (Verluste) | -34 644 538.55 |
| Total der Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung) | 192 510 079.37 |
| Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens infolge Geschäftstätigkeit | 242 154 773.51 |
| **Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode** | **3 519 316 158.24** |

## Entwicklung der Anteile im Umlauf

| | **1.4.2016-30.9.2016** |
|---|---|
| **Klasse** | **F-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 118 198.9290 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 4 833.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -85 609.8520 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **37 422.0770** |
| **Klasse** | **I-A1-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 402 011.9800 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 80 359.8590 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -160 276.7840 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **322 095.0550** |
| **Klasse** | **I-A2-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 0.0000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 101 000.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -24 395.5740 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **76 604.4260** |
| **Klasse** | **I-B-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 45 471.9960 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 17 889.8840 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | 0.0000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **63 361.8800** |
| **Klasse** | **I-B-mdist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 466 097.0290 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 0.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -65 773.8220 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **400 323.2070** |
| **Klasse** | **I-X-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 4 844 509.7710 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 1 507 143.5760 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -3 330 689.1560 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **3 020 964.1910** |
| **Klasse** | **(CHF hedged) I-X-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 0.0000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 9 100.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | 0.0000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **9 100.0000** |
| **Klasse** | **(USD hedged) K-1-6%-mdist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 1.2000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 0.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | 0.0000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **1.2000** |
| **Klasse** | **K-1-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 9.7000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 0.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -1.0000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **8.7000** |
| **Klasse** | **(USD hedged) K-1-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 3.1000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 0.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -1.8000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **1.3000** |
| **Klasse** | **(USD hedged) K-1-mdist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 3.9000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 0.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | 0.0000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **3.9000** |
| **Klasse** | **N-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 114 834.2470 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 5 561.2150 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -17 922.8660 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **102 472.5960** |

| **Klasse** | **P-6%-mdist** |
|---|---|
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 161 657.1810 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 47 359.8790 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -22 696.7670 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **186 320.2930** |
| **Klasse** | **P-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 3 358 637.9870 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 992 576.4450 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -1 656 338.5620 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **2 694 875.8700** |
| **Klasse** | **(CHF hedged) P-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 321 460.5280 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 47 907.2110 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -107 184.2730 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **262 183.4660** |
| **Klasse** | **(USD hedged) P-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 2 626 077.5890 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 118 223.7430 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -1 361 435.5930 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **1 382 865.7390** |
| **Klasse** | **P-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 5 010 671.2870 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 226 638.8430 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -593 716.6940 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **4 643 593.4360** |
| **Klasse** | **P-mdist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 2 380 461.8480 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 94 633.1640 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -545 299.4770 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **1 929 795.5350** |
| **Klasse** | **(JPY) P-mdist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 685.9620 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 0.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | 0.0000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **685.9620** |
| **Klasse** | **(AUD hedged) P-mdist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 3 093 986.2980 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 92 255.2960 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -673 587.0590 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **2 512 654.5350** |
| **Klasse** | **(CAD hedged) P-mdist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 806 325.3830 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 10 279.3120 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -157 581.5960 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **659 023.0990** |
| **Klasse** | **(GBP hedged) P-mdist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 366 377.4910 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 19 897.6160 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -102 159.9300 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **284 115.1770** |
| **Klasse** | **(HKD hedged) P-mdist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 906 703.8490 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 20 555.3760 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -339 411.2420 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **587 847.9830** |
| **Klasse** | **(RMB hedged) P-mdist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 388 395.1700 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 2 994.4070 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -121 631.4410 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **269 758.1360** |
| **Klasse** | **(SGD hedged) P-mdist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 3 422 238.0850 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 74 337.7820 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -993 690.9940 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **2 502 884.8730** |
| **Klasse** | **(USD hedged) P-mdist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 14 314 911.6670 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 364 623.7630 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -4 758 313.4370 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **9 921 221.9930** |
| **Klasse** | **Q-6%-mdist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 2 310.5520 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 7 367.5980 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -1 036.2960 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **8 641.8540** |
| **Klasse** | **(USD hedged) Q-6%-mdist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 172 975.9030 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 1 675.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -100.0000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **174 550.9030** |

| **Klasse** | **Q-acc** |
|---|---|
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 1 487 934.5810 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 784 137.8050 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -374 711.3200 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **1 897 361.0660** |
| **Klasse** | **(CHF hedged) Q-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 596 720.6120 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 304 629.1980 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -193 728.5810 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **707 621.2290** |
| **Klasse** | **(USD hedged) Q-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 202 405.9430 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 68 428.0080 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -71 586.3220 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **199 247.6290** |
| **Klasse** | **Q-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 129 821.6860 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 43 350.5980 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -33 441.0560 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **139 731.2280** |
| **Klasse** | **Q-mdist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 95 299.3770 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 454.8950 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -1 811.1670 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **93 943.1050** |
| **Klasse** | **(GBP hedged) Q-mdist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 1 951.4420 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 5 107.0830 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -100.0000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **6 958.5250** |
| **Klasse** | **(USD hedged) Q-mdist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 42 006.6990 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 63 981.5430 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -16 317.9970 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **89 670.2450** |

## Jährliche Ausschüttung

| **UBS (Lux) Bond Fund** | **Ex-Date** | **Pay-Date** | **Währung** | **Betrag pro Anteil** |
|---|---|---|---|---|
| – Euro High Yield (EUR) N-dist | 1.6.2016 | 6.6.2016 | EUR | 3.49 |
| – Euro High Yield (EUR) P-dist | 1.6.2016 | 6.6.2016 | EUR | 1.90 |
| – Euro High Yield (EUR) Q-dist | 1.6.2016 | 6.6.2016 | EUR | 2.50 |

## Monatliche Ausschüttung

| **UBS (Lux) Bond Fund** | **Ex-Date** | **Pay-Date** | **Währung** | **Betrag pro Anteil** |
|---|---|---|---|---|
| – Euro High Yield (EUR) I-B-mdist | 15.4.2016 | 20.4.2016 | EUR | 0.39 |
| – Euro High Yield (EUR) I-B-mdist | 17.5.2016 | 20.5.2016 | EUR | 0.40 |
| – Euro High Yield (EUR) I-B-mdist | 15.6.2016 | 20.6.2016 | EUR | 0.44 |
| – Euro High Yield (EUR) I-B-mdist | 15.7.2016 | 20.7.2016 | EUR | 0.41 |
| – Euro High Yield (EUR) I-B-mdist | 17.8.2016 | 22.8.2016 | EUR | 0.38 |
| – Euro High Yield (EUR) I-B-mdist | 23.9.2016 | 28.9.2016 | EUR | 0.42 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) K-1-6%-mdist | 11.4.2016 | 14.4.2016 | USD | 23 485.81 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) K-1-6%-mdist | 10.5.2016 | 13.5.2016 | USD | 23 740.86 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) K-1-6%-mdist | 14.6.2016 | 17.6.2016 | USD | 23 758.82 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) K-1-6%-mdist | 11.7.2016 | 14.7.2016 | USD | 23 532.94 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) K-1-6%-mdist | 10.8.2016 | 15.8.2016 | USD | 23 944.95 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) K-1-6%-mdist | 9.9.2016 | 14.9.2016 | USD | 24 362.07 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) K-1-mdist | 15.4.2016 | 20.4.2016 | USD | 26 204.10 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) K-1-mdist | 17.5.2016 | 20.5.2016 | USD | 26 204.10 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) K-1-mdist | 15.6.2016 | 20.6.2016 | USD | 26 204.10 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) K-1-mdist | 15.7.2016 | 20.7.2016 | USD | 26 204.10 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) K-1-mdist | 17.8.2016 | 22.8.2016 | USD | 26 204.10 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) K-1-mdist | 23.9.2016 | 28.9.2016 | USD | 26 204.10 |
| – Euro High Yield (EUR) P-6%-mdist | 11.4.2016 | 14.4.2016 | EUR | 0.45 |
| – Euro High Yield (EUR) P-6%-mdist | 10.5.2016 | 13.5.2016 | EUR | 0.46 |
| – Euro High Yield (EUR) P-6%-mdist | 14.6.2016 | 17.6.2016 | EUR | 0.46 |
| – Euro High Yield (EUR) P-6%-mdist | 11.7.2016 | 14.7.2016 | EUR | 0.45 |
| – Euro High Yield (EUR) P-6%-mdist | 10.8.2016 | 15.8.2016 | EUR | 0.45 |
| – Euro High Yield (EUR) P-6%-mdist | 9.9.2016 | 14.9.2016 | EUR | 0.46 |
| – Euro High Yield (EUR) P-mdist | 15.4.2016 | 20.4.2016 | EUR | 0.64 |
| – Euro High Yield (EUR) P-mdist | 17.5.2016 | 20.5.2016 | EUR | 0.64 |
| – Euro High Yield (EUR) P-mdist | 15.6.2016 | 20.6.2016 | EUR | 0.64 |
| – Euro High Yield (EUR) P-mdist | 15.7.2016 | 20.7.2016 | EUR | 0.64 |
| – Euro High Yield (EUR) P-mdist | 17.8.2016 | 22.8.2016 | EUR | 0.64 |
| – Euro High Yield (EUR) P-mdist | 23.9.2016 | 28.9.2016 | EUR | 0.64 |
| – Euro High Yield (EUR) (JPY) P-mdist | 15.4.2016 | 20.4.2016 | JPY | 48.00 |
| – Euro High Yield (EUR) (JPY) P-mdist | 17.5.2016 | 20.5.2016 | JPY | 48.00 |

| UBS (Lux) Bond Fund | Ex-Date | Pay-Date | Währung | Betrag pro Anteil |
|---|---|---|---|---|
| – Euro High Yield (EUR) (JPY) P-mdist | 15.6.2016 | 20.6.2016 | JPY | 48.00 |
| – Euro High Yield (EUR) (JPY) P-mdist | 15.7.2016 | 20.7.2016 | JPY | 48.00 |
| – Euro High Yield (EUR) (JPY) P-mdist | 17.8.2016 | 22.8.2016 | JPY | 48.00 |
| – Euro High Yield (EUR) (JPY) P-mdist | 23.9.2016 | 28.9.2016 | JPY | 48.00 |
| – Euro High Yield (EUR) (AUD hedged) P-mdist | 15.4.2016 | 20.4.2016 | AUD | 0.65 |
| – Euro High Yield (EUR) (AUD hedged) P-mdist | 17.5.2016 | 20.5.2016 | AUD | 0.65 |
| – Euro High Yield (EUR) (AUD hedged) P-mdist | 15.6.2016 | 20.6.2016 | AUD | 0.65 |
| – Euro High Yield (EUR) (AUD hedged) P-mdist | 15.7.2016 | 20.7.2016 | AUD | 0.65 |
| – Euro High Yield (EUR) (AUD hedged) P-mdist | 17.8.2016 | 22.8.2016 | AUD | 0.65 |
| – Euro High Yield (EUR) (AUD hedged) P-mdist | 23.9.2016 | 28.9.2016 | AUD | 0.65 |
| – Euro High Yield (EUR) (CAD hedged) P-mdist | 15.4.2016 | 20.4.2016 | CAD | 0.51 |
| – Euro High Yield (EUR) (CAD hedged) P-mdist | 17.5.2016 | 20.5.2016 | CAD | 0.51 |
| – Euro High Yield (EUR) (CAD hedged) P-mdist | 15.6.2016 | 20.6.2016 | CAD | 0.51 |
| – Euro High Yield (EUR) (CAD hedged) P-mdist | 15.7.2016 | 20.7.2016 | CAD | 0.51 |
| – Euro High Yield (EUR) (CAD hedged) P-mdist | 17.8.2016 | 22.8.2016 | CAD | 0.51 |
| – Euro High Yield (EUR) (CAD hedged) P-mdist | 23.9.2016 | 28.9.2016 | CAD | 0.51 |
| – Euro High Yield (EUR) (GBP hedged) P-mdist | 15.4.2016 | 20.4.2016 | GBP | 0.49 |
| – Euro High Yield (EUR) (GBP hedged) P-mdist | 17.5.2016 | 20.5.2016 | GBP | 0.49 |
| – Euro High Yield (EUR) (GBP hedged) P-mdist | 15.6.2016 | 20.6.2016 | GBP | 0.49 |
| – Euro High Yield (EUR) (GBP hedged) P-mdist | 15.7.2016 | 20.7.2016 | GBP | 0.49 |
| – Euro High Yield (EUR) (GBP hedged) P-mdist | 17.8.2016 | 22.8.2016 | GBP | 0.49 |
| – Euro High Yield (EUR) (GBP hedged) P-mdist | 23.9.2016 | 28.9.2016 | GBP | 0.49 |
| – Euro High Yield (EUR) (HKD hedged) P-mdist | 15.4.2016 | 20.4.2016 | HKD | 4.87 |
| – Euro High Yield (EUR) (HKD hedged) P-mdist | 17.5.2016 | 20.5.2016 | HKD | 4.87 |
| – Euro High Yield (EUR) (HKD hedged) P-mdist | 15.6.2016 | 20.6.2016 | HKD | 4.87 |
| – Euro High Yield (EUR) (HKD hedged) P-mdist | 15.7.2016 | 20.7.2016 | HKD | 4.87 |
| – Euro High Yield (EUR) (HKD hedged) P-mdist | 17.8.2016 | 22.8.2016 | HKD | 4.87 |
| – Euro High Yield (EUR) (HKD hedged) P-mdist | 23.9.2016 | 28.9.2016 | HKD | 4.87 |
| – Euro High Yield (EUR) (RMB hedged) P-mdist | 15.4.2016 | 20.4.2016 | CNH | 5.80 |
| – Euro High Yield (EUR) (RMB hedged) P-mdist | 17.5.2016 | 20.5.2016 | CNH | 5.80 |
| – Euro High Yield (EUR) (RMB hedged) P-mdist | 15.6.2016 | 20.6.2016 | CNH | 5.80 |
| – Euro High Yield (EUR) (RMB hedged) P-mdist | 15.7.2016 | 20.7.2016 | CNH | 5.80 |
| – Euro High Yield (EUR) (RMB hedged) P-mdist | 17.8.2016 | 22.8.2016 | CNH | 5.80 |
| – Euro High Yield (EUR) (RMB hedged) P-mdist | 23.9.2016 | 28.9.2016 | CNH | 5.80 |
| – Euro High Yield (EUR) (SGD hedged) P-mdist | 15.4.2016 | 20.4.2016 | SGD | 0.49 |
| – Euro High Yield (EUR) (SGD hedged) P-mdist | 17.5.2016 | 20.5.2016 | SGD | 0.49 |
| – Euro High Yield (EUR) (SGD hedged) P-mdist | 15.6.2016 | 20.6.2016 | SGD | 0.49 |
| – Euro High Yield (EUR) (SGD hedged) P-mdist | 15.7.2016 | 20.7.2016 | SGD | 0.49 |
| – Euro High Yield (EUR) (SGD hedged) P-mdist | 17.8.2016 | 22.8.2016 | SGD | 0.49 |
| – Euro High Yield (EUR) (SGD hedged) P-mdist | 23.9.2016 | 28.9.2016 | SGD | 0.49 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) P-mdist | 15.4.2016 | 20.4.2016 | USD | 0.49 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) P-mdist | 17.5.2016 | 20.5.2016 | USD | 0.49 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) P-mdist | 15.6.2016 | 20.6.2016 | USD | 0.49 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) P-mdist | 15.7.2016 | 20.7.2016 | USD | 0.49 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) P-mdist | 17.8.2016 | 22.8.2016 | USD | 0.49 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) P-mdist | 23.9.2016 | 28.9.2016 | USD | 0.49 |
| – Euro High Yield (EUR) Q-6%-mdist | 11.4.2016 | 14.4.2016 | EUR | 0.49 |
| – Euro High Yield (EUR) Q-6%-mdist | 10.5.2016 | 13.5.2016 | EUR | 0.50 |
| – Euro High Yield (EUR) Q-6%-mdist | 14.6.2016 | 17.6.2016 | EUR | 0.50 |
| – Euro High Yield (EUR) Q-6%-mdist | 11.7.2016 | 14.7.2016 | EUR | 0.49 |
| – Euro High Yield (EUR) Q-6%-mdist | 10.8.2016 | 15.8.2016 | EUR | 0.50 |
| – Euro High Yield (EUR) Q-6%-mdist | 9.9.2016 | 14.9.2016 | EUR | 0.51 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) Q-6%-mdist | 11.4.2016 | 14.4.2016 | USD | 0.49 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) Q-6%-mdist | 10.5.2016 | 13.5.2016 | USD | 0.50 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) Q-6%-mdist | 14.6.2016 | 17.6.2016 | USD | 0.50 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) Q-6%-mdist | 11.7.2016 | 14.7.2016 | USD | 0.49 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) Q-6%-mdist | 10.8.2016 | 15.8.2016 | USD | 0.50 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) Q-6%-mdist | 9.9.2016 | 14.9.2016 | USD | 0.51 |
| – Euro High Yield (EUR) Q-mdist | 15.4.2016 | 20.4.2016 | EUR | 0.47 |
| – Euro High Yield (EUR) Q-mdist | 17.5.2016 | 20.5.2016 | EUR | 0.47 |
| – Euro High Yield (EUR) Q-mdist | 15.6.2016 | 20.6.2016 | EUR | 0.47 |
| – Euro High Yield (EUR) Q-mdist | 15.7.2016 | 20.7.2016 | EUR | 0.47 |
| – Euro High Yield (EUR) Q-mdist | 17.8.2016 | 22.8.2016 | EUR | 0.47 |
| – Euro High Yield (EUR) Q-mdist | 23.9.2016 | 28.9.2016 | EUR | 0.47 |
| – Euro High Yield (EUR) (GBP hedged) Q-mdist | 15.4.2016 | 20.4.2016 | GBP | 0.52 |
| – Euro High Yield (EUR) (GBP hedged) Q-mdist | 17.5.2016 | 20.5.2016 | GBP | 0.52 |
| – Euro High Yield (EUR) (GBP hedged) Q-mdist | 15.6.2016 | 20.6.2016 | GBP | 0.53 |
| – Euro High Yield (EUR) (GBP hedged) Q-mdist | 15.7.2016 | 20.7.2016 | GBP | 0.53 |
| – Euro High Yield (EUR) (GBP hedged) Q-mdist | 17.8.2016 | 22.8.2016 | GBP | 0.53 |
| – Euro High Yield (EUR) (GBP hedged) Q-mdist | 23.9.2016 | 28.9.2016 | GBP | 0.53 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) Q-mdist | 15.4.2016 | 20.4.2016 | USD | 0.52 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) Q-mdist | 17.5.2016 | 20.5.2016 | USD | 0.52 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) Q-mdist | 15.6.2016 | 20.6.2016 | USD | 0.52 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) Q-mdist | 15.7.2016 | 20.7.2016 | USD | 0.52 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) Q-mdist | 17.8.2016 | 22.8.2016 | USD | 0.52 |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) Q-mdist | 23.9.2016 | 28.9.2016 | USD | 0.52 |

# Aufstellung der Wertpapierbestände und anderer Nettovermögenswerte per 30. September 2016

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in EUR NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|
| **Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden** | | | | |
| **Mortgage Backed Securities, variabler Zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | BAMLL COMMERCIAL MRT SEC-144A-SUB 1M LIBOR+550BP 14-15.12.31 | 8 025 000.00 | 6 148 260.42 | 0.17 |
| **Total USD** | | | **6 148 260.42** | **0.17** |
| **Total Mortgage Backed Securities, variabler Zins** | | | **6 148 260.42** | **0.17** |
| **Notes, fester Zins** | | | | |
| **EUR** | | | | |
| EUR | ADIENT GLOBAL HOLDINGS LTD-REG-S 3.50000% 16-15.08.24 | 10 725 000.00 | 10 705 802.25 | 0.30 |
| EUR | ALTICE FINCO SA-REG-S 9.00000% 13-15.06.23 | 3 430 000.00 | 3 882 931.50 | 0.11 |
| EUR | ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 4.25000% 14-15.01.22 | 7 380 000.00 | 7 534 020.60 | 0.21 |
| EUR | ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 4.12500% 16-15.05.23 | 7 600 000.00 | 7 791 520.00 | 0.22 |
| EUR | ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 6.75000% 16-15.05.24 | 31 750 000.00 | 33 262 570.00 | 0.95 |
| EUR | BALL CORP 4.37500% 15-15.12.23 | 15 440 000.00 | 17 228 724.00 | 0.49 |
| EUR | CEMEX SAB DE CV-REG-S 4.37500% 15-05.03.23 | 6 210 000.00 | 6 332 647.50 | 0.18 |
| EUR | CERAMTEC GROUP GMBH-REG-S 8.25000% 13-15.08.21 | 16 114 000.00 | 17 043 777.80 | 0.48 |
| EUR | DUFRY FINANCE SCA-REG-S 4.50000% 15-01.08.23 | 15 150 000.00 | 15 926 437.50 | 0.45 |
| EUR | EUROPCAR GROUPE SA-REG-S 5.75000% 15-15.06.22 | 14 375 000.00 | 14 703 325.00 | 0.42 |
| EUR | GALAPAGOS HOLDING SA-REG-S 7.00000% 14-15.06.22 | 1 980 000.00 | 1 655 794.80 | 0.05 |
| EUR | HORIZON HOLDINGS I SASU-REG-S 7.25000% 15-01.08.23 | 3 255 000.00 | 3 495 674.70 | 0.10 |
| EUR | INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-REG-S 4.12500% 15-15.02.20 | 4 161 000.00 | 4 422 893.34 | 0.13 |
| EUR | INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-REG-S 4.75000% 15-15.02.23 | 17 509 000.00 | 18 812 369.96 | 0.53 |
| EUR | KLOECKNER PENTAPLAST OF AMERICA-REG-S 7.12500% 15-01.11.20 | 9 895 000.00 | 10 384 208.80 | 0.30 |
| EUR | LEONARDO - FINMECCANICA S.P.A 4.87500% 05-24.03.25 | 8 529 000.00 | 10 016 287.02 | 0.28 |
| EUR | LINCOLN FINANCE LTD-REG-S 6.87500% 16-15.04.21 | 28 625 000.00 | 30 811 377.50 | 0.88 |
| EUR | LOCK AS-REG-S 7.00000% 14-15.08.21 | 8 375 000.00 | 8 731 272.50 | 0.25 |
| EUR | LOCK LOWER HOLDING AS-REG-S 9.50000% 14-15.08.22 | 6 020 000.00 | 6 422 918.60 | 0.18 |
| EUR | MATTERHORN TELECOM HOLDING SA REG-S 4.87500% 15-01.05.23 | 4 715 000.00 | 4 650 687.40 | 0.13 |
| EUR | NOVAFIVES SAS-REG-S 4.50000% 14-30.06.21 | 14 183 000.00 | 12 392 679.91 | 0.35 |
| EUR | OI EUROPEAN GROUP BV-REG-S 6.75000% 10-15.09.20 | 1 175 000.00 | 1 408 872.00 | 0.04 |
| EUR | OI EUROPEAN GROUP BV-REG-S 4.87500% 13-31.03.21 | 1 460 000.00 | 1 664 341.60 | 0.05 |
| EUR | PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 3.25000% 12-01.04.19 | 9 725 000.00 | 9 739 393.00 | 0.28 |
| EUR | PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 4.25000% 12-02.10.23 | 14 300 000.00 | 13 283 985.00 | 0.38 |
| EUR | PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 4.75000% 14-14.01.25 | 8 040 000.00 | 7 437 160.80 | 0.21 |
| EUR | PSPC ESCROW CORP-REG-S 6.00000% 15-01.02.23 | 13 550 000.00 | 12 702 176.50 | 0.36 |
| EUR | SB CAPITAL SA FOR SBERBANK-REG-S LPN 3.35240% 14-15.11.19 | 4 867 000.00 | 5 112 053.45 | 0.15 |
| EUR | SPCM SA-REG-S 2.87500% 15-15.06.23 | 7 940 000.00 | 7 921 182.20 | 0.23 |
| EUR | TRIONISTA HOLDCO GMBH-REG-S 5.00000% 13-30.04.20 | 3 890 000.00 | 3 986 394.20 | 0.11 |
| EUR | TRIONISTA TOPCO GMBH-REG-S-SUB 6.87500% 13-30.04.21 | 14 870 000.00 | 15 615 581.80 | 0.44 |
| EUR | UNITYMEDIA KABELBW GMBH-REG-S 5.75000% 12-15.01.23 | 12 940 000.00 | 11 084 080.50 | 0.32 |
| EUR | UPC HOLDING BV-REG-S 6.75000% 13-15.03.23 | 4 475 000.00 | 4 809 416.75 | 0.14 |
| EUR | VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-REG-S 4.50000% 15-15.05.23 | 17 750 000.00 | 14 058 532.50 | 0.40 |
| EUR | VEB FINANCE PLC-REG-S LPN 4.03200% 13-21.02.23 | 10 000 000.00 | 10 162 500.00 | 0.29 |
| EUR | VERALLIA PACKAGING SASU-REG-S 5.12500% 15-01.08.22 | 4 935 000.00 | 5 176 864.35 | 0.15 |
| EUR | VIRIDIAN GROUP FUNDCO II-REG-S 7.50000% 15-01.03.20 | 15 718 000.00 | 16 592 077.98 | 0.47 |
| EUR | VOTORANTIM CIMENTOS SA-REG-S 3.50000% 15-13.07.22 | 9 235 000.00 | 8 864 214.75 | 0.25 |
| EUR | XPO LOGISTICS INC-REG-S 5.75000% 15-15.06.21 | 7 275 000.00 | 7 398 820.50 | 0.21 |
| **Total EUR** | | | **403 225 568.56** | **11.47** |
| **GBP** | | | | |
| GBP | CABOT FINANCIAL LUXEMBOURG SA-REG-S 10.37500% 12-01.10.19 | 3 470 000.00 | 4 200 851.11 | 0.12 |
| GBP | CO-OPERATIVE BANK PLC 5.12500% 10-20.09.17 | 5 200 000.00 | 5 678 167.35 | 0.16 |
| GBP | GALA ELECTRIC CASINOS LTD REG-S 11.50000% 11-01.06.19 | 13 292 000.00 | 10 085 301.23 | 0.29 |
| GBP | GALA GROUP FINANCE-REG-S 8.87500% 11-01.09.18 | 5 420 000.00 | 1 609 378.41 | 0.05 |
| GBP | KEYSTONE FINANCING PLC-REG-S 14-15.10.19 | 17 145 000.00 | 20 567 610.22 | 0.58 |
| GBP | NWEN FINANCE PLC-REG-S 5.87500% 13-21.06.21 | 5 970 000.00 | 7 534 966.01 | 0.21 |
| GBP | VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC 5.50000% 11-15.01.21 | 7 550 000.00 | 9 587 877.62 | 0.27 |
| **Total GBP** | | | **59 264 151.95** | **1.68** |
| **USD** | | | | |
| USD | AECOM TECHNOLOGY CORP 5.87500% 15-15.10.24 | 9 675 000.00 | 9 190 302.99 | 0.26 |
| USD | AMERICAN AXLE & MANUFACTURING INC 6.25000% 13-15.03.21 | 5 870 000.00 | 5 458 400.08 | 0.16 |
| USD | ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-144A 6.25000% 14-31.01.19 | 1 740 000.00 | 1 581 219.97 | 0.04 |
| USD | BOMBARDIER INC-REG-S 6.12500% 13-15.01.23 | 12 065 000.00 | 9 528 107.76 | 0.27 |
| USD | FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV 4.50000% 15-15.04.20 | 3 150 000.00 | 2 880 072.07 | 0.08 |
| USD | HCA INC 7.50000% 11-15.02.22 | 8 265 000.00 | 8 439 301.92 | 0.24 |
| USD | INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-144A 6.25000% 15-15.02.22 | 4 000 000.00 | 3 772 913.33 | 0.11 |
| USD | NOKIA CORP 6.62500% 09-15.05.39 | 1 059 000.00 | 1 022 437.27 | 0.03 |
| USD | PULTEGROUP INC 5.50000% 16-01.03.26 | 1 653 000.00 | 1 544 447.41 | 0.04 |
| USD | UBS AG STAMFORD-SUB 7.62500% 12-17.08.22 | 5 430 000.00 | 5 629 071.01 | 0.16 |
| **Total USD** | | | **49 046 273.81** | **1.39** |
| **Total Notes, fester Zins** | | | **511 535 994.32** | **14.54** |
| **Notes, variabler Zins** | | | | |
| **EUR** | | | | |
| EUR | FUERSTENBERG CAPITAL GMBH-SUB 5.344%/VAR 05-PRP | 7 348 000.00 | 4 059 770.00 | 0.11 |
| EUR | GROUPAMA VAR-REG-S-SUB 7.875%/3M EURIBOR+536BP 09-27.10.39 | 23 850 000.00 | 25 416 706.50 | 0.72 |
| EUR | ING GROUP NV-SUB VAR 03-PRP | 5 587 300.00 | 3 408 867.60 | 0.10 |
| EUR | INTESA SANPAOLO SPA-SUB 8.375%/3M EURIBOR+687.1BP 09-PRP | 3 100 000.00 | 3 496 676.00 | 0.10 |
| EUR | LCH CLEARNET SA VIA FRESHWAT-SUB 6.576%/3M EURIBOR+210BP PRP | 5 900 000.00 | 5 913 239.60 | 0.17 |
| EUR | LOCK AS-REG-S 3M EURIBOR+550BP 14-15.08.20 | 1 070 000.00 | 1 070 449.40 | 0.03 |
| EUR | NOVAFIVES SAS-REG-S 3M EURIBOR+400BP 14-30.06.20 | 1 990 000.00 | 1 753 747.20 | 0.05 |
| **Total EUR** | | | **45 119 456.30** | **1.28** |

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in EUR NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|
| **GBP** | | | | |
| GBP | LIVERPOOL VICTORIA FRIENDLY-REG-S-SUB 6.500%/VAR 13-22.05.43 | 4 325 000.00 | 4 940 224.56 | 0.14 |
| **Total GBP** | | | **4 940 224.56** | **0.14** |
| **USD** | | | | |
| USD | AEGON NV-SUB VAR/10YR CMS+10BP 04-31.12.PRP | 7 310 000.00 | 4 293 112.65 | 0.12 |
| USD | BARCLAYS BANK PLC-SUB 6M LIBOR+25BP 86-PRP | 6 980 000.00 | 4 327 562.73 | 0.12 |
| USD | CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 7.500%/VAR 11-PRP | 2 400 000.00 | 2 170 678.06 | 0.06 |
| USD | CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 6.250%/VAR 14-PRP | 7 750 000.00 | 6 540 053.84 | 0.19 |
| USD | HSBC BANK PLC-SUB 6M LIBOR+25BP 85-PRP | 25 280 000.00 | 15 244 258.41 | 0.44 |
| USD | SOCIETE GENERALE-REG-S-SUB 6.000%VAR 14-PRP | 13 700 000.00 | 10 941 226.20 | 0.31 |
| **Total USD** | | | **43 516 891.89** | **1.24** |
| **Total Notes, variabler Zins** | | | **93 576 572.75** | **2.66** |
| **Medium-Term Notes, fester Zins** | | | | |
| **EUR** | | | | |
| EUR | AGROKOR DD-REG-S 9.12500% 12-01.02.20 | 12 925 000.00 | 13 449 755.00 | 0.38 |
| EUR | ALTICE FINANCING SA-REG-S 5.25000% 15-15.02.23 | 4 510 000.00 | 4 674 479.70 | 0.13 |
| EUR | ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC 3.50000% 12-28.03.22 | 24 440 000.00 | 24 984 767.60 | 0.71 |
| EUR | ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC 2.75000% 12-07.06.19 | 7 470 000.00 | 7 702 541.10 | 0.22 |
| EUR | ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-REG-S 2.87500% 13-20.11.20 | 24 775 000.00 | 25 087 412.75 | 0.71 |
| EUR | ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-REG-S 1.50000% 15-01.04.20 | 20 995 000.00 | 20 567 331.85 | 0.58 |
| EUR | ARCELORMITTAL-REG-S 3.00000% 14-25.03.19 | 2 495 000.00 | 2 594 700.20 | 0.07 |
| EUR | ARCELORMITTAL-REG-S 3.12500% 15-14.01.22 | 23 830 000.00 | 24 159 092.30 | 0.69 |
| EUR | ARCELORMITTAL-REG-S 3.00000% 15-09.04.21 | 14 895 000.00 | 15 078 804.30 | 0.43 |
| EUR | AREVA SA 3.50000% 10-22.03.21 | 3 950 000.00 | 3 810 288.50 | 0.11 |
| EUR | AREVA SA 4.37500% 09-06.11.19 | 8 100 000.00 | 8 201 250.00 | 0.23 |
| EUR | AREVA SA 4.87500% 09-23.09.24 | 9 400 000.00 | 9 550 400.00 | 0.27 |
| EUR | AREVA SA-REG-S 3.12500% 14-20.03.23 | 16 500 000.00 | 15 592 500.00 | 0.44 |
| EUR | BANCO POPOLARE SC REG-S-SUB 6.00000% 10-05.11.20 | 10 818 000.00 | 11 271 057.84 | 0.32 |
| EUR | BANCO POPOLARE SC REG-S-SUB 6.37500% 11-31.05.21 | 7 685 000.00 | 8 143 102.85 | 0.23 |
| EUR | BANCO POPOLARE SC-REG-S 3.50000% 14-14.03.19 | 17 970 000.00 | 18 586 910.10 | 0.53 |
| EUR | BANCO POPOLARE SCARL 5.47300% 09-12.11.16 | 2 270 000.00 | 2 372 604.00 | 0.07 |
| EUR | BANCO POPOLARE SCARL-SUB 4.75000% 10-28.04.17 | 3 940 000.00 | 3 984 837.20 | 0.11 |
| EUR | BANK FUER ARBEIT UND WIRTS AG-REG-S-SUB 8.12500% 13-30.10.23 | 6 100 000.00 | 7 672 824.00 | 0.22 |
| EUR | BEFESA ZINC ASER SA -REG-S 8.87500% 11-15.05.18 | 7 461 000.00 | 7 592 238.99 | 0.22 |
| EUR | BPE FINANCIACIONES SA-SUB 6.87300% 10-22.10.20 | 2 200 000.00 | 2 359 588.00 | 0.07 |
| EUR | CAMPOFRIO FOOD GROUP SA-REG-S 3.37500% 15-15.03.22 | 7 580 000.00 | 7 799 062.00 | 0.22 |
| EUR | CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S 3.31100% 13-25.01.23 | 21 200 000.00 | 23 465 856.00 | 0.67 |
| EUR | CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S 3.24800% 14-07.03.24 | 37 600 000.00 | 40 686 208.00 | 1.16 |
| EUR | CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S 2.33000% 14-07.02.25 | 6 000 000.00 | 6 086 580.00 | 0.17 |
| EUR | CELLNEX TELECOM SAU-REG-S 2.37500% 16-16.01.24 | 4 400 000.00 | 4 505 732.00 | 0.13 |
| EUR | COTT CORP-REG-S 5.50000% 16-01.07.24 | 11 435 000.00 | 11 971 415.85 | 0.34 |
| EUR | FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV-REG-S 3.75000% 16-29.03.24 | 7 380 000.00 | 7 597 341.00 | 0.22 |
| EUR | FIAT CHRYSLER FINANCE EUROPE 7.37500% 11-09.07.18 | 4 760 000.00 | 5 238 998.80 | 0.15 |
| EUR | FIAT CHRYSLER FINANCE EUROPE-REG-S 6.75000% 13-14.10.19 | 11 050 000.00 | 12 522 854.50 | 0.36 |
| EUR | FIAT CHRYSLER FINANCE EUROPE-REG-S 4.75000% 14-22.03.21 | 3 420 000.00 | 3 729 407.40 | 0.11 |
| EUR | FIAT CHRYSLER FINANCE EUROPE-REG-S 4.75000% 14-15.07.22 | 14 340 000.00 | 15 642 215.40 | 0.44 |
| EUR | FINMECCANICA FINANCE SA 4.50000% 13-19.01.21 | 10 900 000.00 | 12 204 948.00 | 0.35 |
| EUR | GAZ CAPITAL SA/GAZPROM LPN 6.60500% 07-13.02.18 | 3 220 000.00 | 3 442 115.60 | 0.10 |
| EUR | GAZ CAPITAL SA/GAZPROM LPN-REG-S 3.75500% 12-15.03.17 | 80 000.00 | 80 992.80 | 0.00 |
| EUR | GAZ CAPITAL SA/GAZPROM-REG-S LPN 3.38900% 13-20.03.20 | 6 250 000.00 | 6 482 687.50 | 0.18 |
| EUR | GAZ CAPITAL SA/GAZPROM-REG-S LPN 3.70000% 13-25.07.18 | 17 360 000.00 | 17 963 607.20 | 0.51 |
| EUR | GAZPROM OAO-REG-S LPN 3.60000% 14-26.02.21 | 16 040 000.00 | 16 839 433.60 | 0.48 |
| EUR | GREIF LUXEMBOURG FINANCE SCA-REG-S 7.37500% 11-15.07.21 | 3 410 000.00 | 4 093 705.00 | 0.12 |
| EUR | HEIDELBERGCEMENT AG-REG-S 2.25000% 16-30.03.23 | 4 780 000.00 | 5 027 221.60 | 0.14 |
| EUR | HEIDELBERGCEMENT AG-REG-S 2.25000% 16-03.06.24 | 6 425 000.00 | 6 760 834.75 | 0.19 |
| EUR | INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 6.62500% 13-13.09.23 | 6 523 000.00 | 7 646 651.98 | 0.22 |
| EUR | INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 3.92800% 14-15.09.26 | 8 035 000.00 | 8 102 976.10 | 0.23 |
| EUR | PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 4.87500% 11-07.03.18 | 12 790 000.00 | 13 119 086.70 | 0.37 |
| EUR | PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 5.87500% 11-07.03.22 | 5 975 000.00 | 6 114 934.50 | 0.17 |
| EUR | PEUGEOT SA-REG-S 2.37500% 16-14.04.23 | 8 585 000.00 | 9 052 710.80 | 0.26 |
| EUR | RAIFFEISENLANDESBANK NIED-REG-S-SUB 5.87500% 13-27.11.23 | 2 700 000.00 | 2 648 916.00 | 0.07 |
| EUR | ROYAL BANK OF SCOTLAND PLC-REG-S-SUB STEP-UP/DOWN 05-PRP | 28 304 000.00 | 26 775 584.00 | 0.76 |
| EUR | SCHAEFFLER FINANCE BV-REG-S 3.50000% 14-15.05.22 | 9 840 000.00 | 10 126 344.00 | 0.29 |
| EUR | SNS BANK NV-SUB *DEFAULT* 6.25000% 10-26.10.20* | 1 300 000.00 | 0.13 | 0.00 |
| EUR | TECHEM ENERGY METERING SERV-REG-S-SUB 7.87500% 12-01.10.20 | 525 000.00 | 547 034.25 | 0.02 |
| EUR | TELECOM ITALIA FINANCE SA 7.75000% 03-24.01.33 | 11 686 000.00 | 15 564 466.54 | 0.44 |
| EUR | TELECOM ITALIA SPA 5.25000% 10-10.02.22 | 33 300 000.00 | 39 180 447.00 | 1.11 |
| EUR | TELECOM ITALIA SPA-REG-S 4.50000% 14-25.01.21 | 2 015 000.00 | 2 257 001.50 | 0.06 |
| EUR | TELECOM ITALIA SPA-REG-S 3.62500% 16-19.01.24 | 9 855 000.00 | 10 444 624.65 | 0.30 |
| EUR | TELECOM ITALIA SPA-REG-S 3.62500% 16-25.05.26 | 18 315 000.00 | 18 980 567.10 | 0.54 |
| EUR | TELECOM ITALIA SPA-REG-S 3.00000% 16-30.09.25 | 2 826 000.00 | 2 824 728.30 | 0.08 |
| EUR | TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 2.12500% 13-12.11.20 | 4 200 000.00 | 4 340 826.00 | 0.12 |
| EUR | TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES-REG-S 2.50000% 14-01.07.24 | 15 870 000.00 | 16 415 769.30 | 0.47 |
| EUR | THYSSENKRUPP AG-REG-S 2.75000% 16-08.03.21 | 5 945 000.00 | 6 230 716.70 | 0.18 |
| EUR | UNITYMEDIA HESSEN/NRW GMBH-REG-S 5.62500% 13-15.04.23 | 7 018 000.00 | 5 943 347.70 | 0.17 |
| EUR | UNITYMEDIA KABELBW GMBH-REG-S 5.12500% 13-21.01.23 | 14 535 000.00 | 12 347 300.81 | 0.35 |
| EUR | VIRGIN MEDIA FINANCE PLC-REG-S 4.50000% 15-15.01.25 | 12 900 000.00 | 12 770 484.00 | 0.36 |
| EUR | WEPA HYGIENEPRODUKTE GMBH-REG-S 3.75000% 16-15.05.24 | 9 870 000.00 | 10 191 268.50 | 0.29 |
| **Total EUR** | | | **691 203 489.84** | **19.64** |
| **GBP** | | | | |
| GBP | ANGLIAN WATER/OSPREY FINANCING-REG-S 5.00000% 15-30.04.23 | 7 810 000.00 | 9 405 560.69 | 0.27 |
| GBP | BAKKAVOR FINANCE 2 PLC-REG-S 8.25000% 11-15.02.18 | 5 771 000.00 | 2 390 914.32 | 0.07 |
| GBP | CPUK FINANCE LTD-REG-S 7.00000% 15-28.08.20 | 11 110 000.00 | 13 535 386.85 | 0.38 |
| GBP | EDU UK BONDCO PLC-REG-S 8.87500% 13-15.09.18 | 5 342 000.00 | 6 209 394.77 | 0.18 |
| GBP | GHD BONDCO PLC REG-S 7.00000% 14-15.04.20 | 14 020 000.00 | 16 114 474.60 | 0.46 |
| GBP | JERROLD FINCO PLC-REG-S 9.75000% 13-15.09.18 | 10 652 000.00 | 12 927 413.08 | 0.37 |
| GBP | JERROLD FINCO PLC-REG-S 6.25000% 16-15.09.21 | 14 755 000.00 | 17 063 826.63 | 0.48 |
| GBP | LEONARDO - FINMECCANICA S.P.A 8.00000% 09-16.12.19 | 1 485 000.00 | 2 016 127.93 | 0.06 |

* Siehe Erläuterung 8

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in EUR NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|
| GBP | MARLIN INTERMEDIATE HOLDINGS LTD-REG-S 10.50000% 13-01.08.20 | 2 700 000.00 | 3 327 378.44 | 0.09 |
| GBP | TESCO PLC 6.12500% 09-24.02.22 | 9 040 000.00 | 11 924 151.43 | 0.34 |
| GBP | VIRGIN MEDIA SECURE FIN PLC-REG-S 5.12500% 28.01.15-15.01.25 | 770 000.00 | 911 644.04 | 0.02 |
| **Total GBP** | | | **95 826 272.78** | **2.72** |
| **Total Medium-Term Notes, fester Zins** | | | **787 029 762.62** | **22.36** |
| **Medium-Term Notes, variabler Zins** | | | | |
| **CHF** | | | | |
| CHF | RAIFFEISEN BANK INTL-SUB 4.000%/SFSW5+361.75BP 13-24.05.23 | 1 800 000.00 | 1 685 313.24 | 0.05 |
| **Total CHF** | | | **1 685 313.24** | **0.05** |
| **EUR** | | | | |
| EUR | ALLIED IRISH BANKS PLC-REG-S-SUB 4.125%/VAR 15-26.11.25 | 3 160 000.00 | 3 039 066.80 | 0.09 |
| EUR | ALLIED IRISH BANKS PLC-REG-S-SUB 7.375%/VAR 15-PRP | 7 715 000.00 | 6 935 553.55 | 0.20 |
| EUR | BANK OF IRELAND-REG-S-SUB 4.25%/VAR 14-11.06.24 | 3 580 000.00 | 3 550 751.40 | 0.10 |
| EUR | BANKIA SA-REG-S-SUB 4.000%/VAR 14-22.05.24 | 11 400 000.00 | 11 313 588.00 | 0.32 |
| EUR | BARCLAYS BANK PLC-SUB 4.75000%/3M EURIBOR+71BP 05-PRP | 5 800 000.00 | 5 507 970.00 | 0.16 |
| EUR | BILBAO LUXEMBOURG SA-REG-S (PIK) VAR 13-01.12.18 | 6 432 187.00 | 6 482 615.34 | 0.18 |
| EUR | CREDIT AGRICOLE SA 7.87500%/3M EURIBOR+642.4BP 09-PRP | 800 000.00 | 940 352.00 | 0.03 |
| EUR | DELTA LLOYD NV-REG-S-SUB 3M EURIBOR+290BP 14-PRP | 12 380 000.00 | 9 724 737.60 | 0.28 |
| EUR | HBOS EURO FINANCE LP-SUB 7.627%/3M EURIBOR+287.5BP-PRP | 2 600 000.00 | 2 539 680.00 | 0.07 |
| EUR | INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 7.000%/VAR 16-PRP | 455 000.00 | 421 876.00 | 0.01 |
| EUR | NATIONAL WESTMINSTER BANK PLC-SUB 6.62500%/FLR 99-05.10.PRP | 2 530 000.00 | 2 293 824.50 | 0.06 |
| EUR | ORANGE SA REG-S-SUB 5.000%/VAR 14-PRP | 6 370 000.00 | 6 900 366.20 | 0.19 |
| EUR | ORIGIN ENERGY FINANCE LTD-SUB 7.875%/VAR 11-16.06.71 | 4 880 000.00 | 5 177 680.00 | 0.15 |
| EUR | RAIFFEISEN BANK INT-REG-S-SUB 4.500%/EUSA5+330BP 14-21.02.25 | 10 900 000.00 | 10 126 318.00 | 0.29 |
| EUR | RAIFFEISEN BANK INTL AG-SUB 5.163%/VAR 13-18.06.24 | 14 400 000.00 | 13 805 136.00 | 0.39 |
| EUR | ROYAL BK OF SCOTLAND GP PLC-REG-S-SUB 3.625/VAR 14-25.03.24 | 9 525 000.00 | 9 466 135.50 | 0.27 |
| EUR | RWE AG-REG-S-SUB 3.500%/VAR 15-21.04.75 | 15 008 000.00 | 13 036 399.04 | 0.37 |
| EUR | SANTOS FIN LTD-SUB 8.250%/3M EURIBOR+685.1BP 10-22.09.70 | 13 025 000.00 | 13 520 992.00 | 0.38 |
| EUR | SNS REAAL GROEP-SUB *DEFAULT* 6.258%/3M EURIBOR+229BP 07-PRP* | 1 000 000.00 | 0.10 | 0.00 |
| EUR | UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 4.375%/VAR 16-03.01.27 | 8 110 000.00 | 8 039 605.20 | 0.23 |
| EUR | UNIPOLSAI SPA-SUB 5.750%/VAR 14-PRP | 9 540 000.00 | 9 073 398.60 | 0.26 |
| **Total EUR** | | | **141 896 045.83** | **4.03** |
| **GBP** | | | | |
| GBP | ARGON CAP PLC FOR RBS-SUB 8.162%/3M LIBOR+233BP 07-PRP | 1 940 000.00 | 1 681 833.96 | 0.05 |
| **Total GBP** | | | **1 681 833.96** | **0.05** |
| **USD** | | | | |
| USD | ARCELOR MITTAL 9.850%/RATING LINKED 09-01.06.19 | 5 210 000.00 | 5 609 628.05 | 0.16 |
| USD | BPCE SA-SUB 10Y CMT+30BP 04-PRP | 9 253 000.00 | 5 475 391.53 | 0.16 |
| USD | HSBC BANK PLC-SUB 6M LIBOR+25BP 85-PRP | 22 330 000.00 | 13 472 711.51 | 0.38 |
| USD | ROYAL BANK OF SC PLC-SUB 7.64000%/3M LIBOR+232BP 07-PRP | 5 300 000.00 | 4 574 657.41 | 0.13 |
| **Total USD** | | | **29 132 388.50** | **0.83** |
| **Total Medium-Term Notes, variabler Zins** | | | **174 395 581.53** | **4.96** |
| **Anleihen, fester Zins** | | | | |
| **EUR** | | | | |
| EUR | ALIZE FINCO PLC-REG-S 6.25000% 14-01.12.21 | 3 940 000.00 | 4 189 796.00 | 0.12 |
| EUR | ALTICE LUXEMBOURG SA-REG-S 7.25000% 14-15.05.22 | 46 180 000.00 | 48 706 046.00 | 1.38 |
| EUR | ALTICE LUXEMBOURG SA-REG-S 6.25000% 15-15.02.25 | 12 870 000.00 | 12 925 855.80 | 0.37 |
| EUR | AURIS LUXEMBOURG II SARL-REG-S 8.00000% 14-15.01.23 | 4 940 000.00 | 5 333 075.80 | 0.15 |
| EUR | BILBAO LUXEMBOURG SA-144A (PIK) 10.50000% 13-01.12.18 | 912 656.00 | 910 602.52 | 0.03 |
| EUR | BISOHO SASU 5.87500% 16-01.05.23 | 6 210 000.00 | 6 644 700.00 | 0.19 |
| EUR | BMBG BOND FINANCE SCA-REG-S 3.00000% 16-15.06.21 | 6 070 000.00 | 6 183 023.40 | 0.18 |
| EUR | CEMEX FINANCE LLC-REG-S 4.62500% 16-15.06.24 | 10 870 000.00 | 11 127 945.10 | 0.32 |
| EUR | CEMEX SAB DE CV-REG-S 4.75000% 14-11.01.22 | 7 229 000.00 | 7 429 893.91 | 0.21 |
| EUR | CERBERUS NIGHTINGALE 1 SARL-REG-S 8.25000% 15-01.02.20 | 9 205 000.00 | 9 430 522.50 | 0.27 |
| EUR | CIRSA FUNDING LUXEMBOURG SA-REG-S 5.75000% 16-15.05.21 | 14 395 000.00 | 15 089 702.70 | 0.43 |
| EUR | CMC RAVENNA-REG-S 7.50000% 14-01.08.21 | 11 740 000.00 | 8 644 866.40 | 0.25 |
| EUR | CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 4.00000% 14-15.07.22 | 10 650 000.00 | 11 605 305.00 | 0.33 |
| EUR | CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 2.62500% 16-30.09.24 | 4 535 000.00 | 4 472 280.95 | 0.13 |
| EUR | DAKAR FINANCE SA-REG-S (PIK) 9.00000% 15-15.11.20 | 11 970 000.00 | 12 122 019.00 | 0.34 |
| EUR | EDREAMS ODIGEO SA-REG-S 8.50000% 16-01.08.21 | 4 540 000.00 | 4 599 564.80 | 0.13 |
| EUR | EIRCOM FINANCE DAC-REG-S 4.50000% 16-31.05.22 | 12 135 000.00 | 12 307 195.65 | 0.35 |
| EUR | ELIS SA-REG-S 3.00000% 15-30.04.22 | 6 210 000.00 | 6 242 975.10 | 0.18 |
| EUR | EPHIOS BONDCO PLC-REG-S 6.25000% 15-01.07.22 | 16 440 000.00 | 17 415 385.20 | 0.49 |
| EUR | ETHIAS SA-REG-S SUB 5.00000% 15-14.01.26 | 8 200 000.00 | 6 724 000.00 | 0.19 |
| EUR | FAURECIA-REG-S 3.62500% 16-15.06.23 | 13 565 000.00 | 13 883 913.15 | 0.39 |
| EUR | FINMECCANICA SPA 5.25000% 09-21.01.22 | 4 200 000.00 | 4 930 338.00 | 0.14 |
| EUR | GALAPAGOS SA/LUXEMBOURG-REG-S 5.37500% 14-15.06.21 | 3 570 000.00 | 3 327 561.30 | 0.09 |
| EUR | GAMENET GROUP SPA-REG-S 6.00000% 16-15.08.21 | 4 606 000.00 | 4 604 157.60 | 0.13 |
| EUR | GARFUNKELUX HOLDCO 3 SA-REG-S 7.50000% 15-01.08.22 | 14 285 000.00 | 14 646 839.05 | 0.42 |
| EUR | GAZPROM NEFT OAO VIA GPN CAP-REG-S LPN 2.93300% 13-26.04.18 | 5 200 000.00 | 5 303 584.00 | 0.15 |
| EUR | GESTAMP FUNDING LUXEMBOURG SA-REG-S 3.50000% 16-15.05.23 | 13 540 000.00 | 13 938 076.00 | 0.40 |
| EUR | GOODYEAR DUNLOP TIRES EUROPE BV-REG-S 3.75000% 15-15.12.23 | 8 335 000.00 | 8 694 071.80 | 0.25 |
| EUR | GPB EUROBOND FINANCE PLC LPN-REG-S 3.98400% 13-30.10.18 | 11 640 000.00 | 12 076 500.00 | 0.34 |
| EUR | GPB EUROBOND FINANCE PLC LPN-REG-S 4.00000% 14-01.07.19 | 21 830 000.00 | 22 660 849.80 | 0.64 |
| EUR | GRUPO ANTOLIN DUTCH BV-REG-S 5.12500% 15-30.06.22 | 7 200 000.00 | 7 665 912.00 | 0.22 |
| EUR | IMS HEALTH INC-REG-S 4.12500% 15-01.04.23 | 8 215 000.00 | 8 459 889.15 | 0.24 |
| EUR | INEOS FINANCE PLC-REG-S 4.00000% 15-01.05.23 | 11 270 000.00 | 11 289 497.10 | 0.32 |
| EUR | INEOS GROUP HOLDINGS SA-REG-S 5.37500% 16-01.08.24 | 29 635 000.00 | 28 980 362.85 | 0.82 |
| EUR | INOVYN FINANCE PLC-REG-S 6.25000% 16-15.05.21 | 9 875 000.00 | 10 210 848.75 | 0.29 |
| EUR | INTRALOT CAPITAL LUXEMBOURG SA-REG-S 6.75000% 16-15.09.21 | 9 007 000.00 | 9 013 935.39 | 0.26 |
| EUR | LECTA SA-REG-S 6.50000% 16-01.08.23 | 5 375 000.00 | 5 294 912.50 | 0.15 |
| EUR | LKQ ITALIA BONDCO SPA-REG-S 3.87500% 16-01.04.24 | 15 530 000.00 | 16 528 113.10 | 0.47 |
| EUR | LSF9 BALTA ISSUER SA-REG-S 7.75000% 15-15.09.22 | 10 790 000.00 | 11 551 450.30 | 0.33 |
| EUR | MATTERHORN TELECOM SA-REG-S 3.87500% 15-01.05.22 | 9 875 000.00 | 9 825 427.50 | 0.28 |
| EUR | MERCURY BONDCO PLC-REG-S (PIK) 8.25000% 15-30.05.21 | 1 550 000.00 | 1 604 312.00 | 0.05 |
| EUR | NH HOTEL GROUP SA-REG-S 3.75000% 16-01.10.23 | 3 772 000.00 | 3 802 176.00 | 0.11 |

* Siehe Erläuterung 8

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in EUR NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|
| EUR | NYRSTAR NETHERLANDS HOLDINGS BV-REG-S 8.50000% 14-15.09.19 | 6 430 000.00 | 6 696 652.10 | 0.19 |
| EUR | ONEX WIZARD ACQUISITION CO II SCA-REG-S 7.75000% 15-15.02.23 | 3 960 000.00 | 4 152 060.00 | 0.12 |
| EUR | PAPREC HOLDING-REG-S 5.25000% 15-01.04.22 | 1 490 000.00 | 1 551 149.60 | 0.04 |
| EUR | PAPREC HOLDING-REG-S-SUB 7.37500% 15-01.04.23 | 13 915 000.00 | 14 169 087.90 | 0.40 |
| EUR | PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 3.75000% 14-14.01.21 | 20 100 000.00 | 19 612 977.00 | 0.56 |
| EUR | REXEL SA-REG-S 3.50000% 16-15.06.23 | 15 910 000.00 | 16 291 203.60 | 0.46 |
| EUR | ROYAL BANK OF SCOTLAND PLC-SUB 5.50000% 04-PRP | 27 981 000.00 | 26 560 964.25 | 0.75 |
| EUR | SCHAEFFLER VERWALT ZWE GMBH-REG-S (PIK) 2.75000% 16-15.09.21 | 6 054 000.00 | 6 051 336.24 | 0.17 |
| EUR | SCHAEFFLER VERWALT ZWE GMBH-REG-S (PIK) 3.25000% 16-15.09.23 | 9 776 000.00 | 9 741 686.24 | 0.28 |
| EUR | SCHAEFFLER VERWALT ZWE GMBH-REG-S (PIK) 3.75000% 16-15.09.26 | 8 271 000.00 | 8 233 284.24 | 0.23 |
| EUR | SCHUMANN SPA-REG-S 7.00000% 16-31.07.23 | 11 539 000.00 | 11 539 000.00 | 0.33 |
| EUR | SFR GROUP SA-REG-S 5.62500% 14-15.05.24 | 11 780 000.00 | 12 147 653.80 | 0.34 |
| EUR | SFR GROUP SA-REG-S 5.37500% 14-15.05.22 | 10 750 000.00 | 11 091 420.00 | 0.31 |
| EUR | SNAI SPA-REG-S 7.62500% 13-15.06.18 | 5 350 000.00 | 5 461 387.00 | 0.15 |
| EUR | SNAI SPA-REG-S 7.62500% 15-15.06.18 | 4 240 000.00 | 4 291 388.80 | 0.12 |
| EUR | SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 4.75000% 15-30.07.25 | 18 215 000.00 | 19 976 208.35 | 0.57 |
| EUR | SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 4.00000% 15-30.07.22 | 12 790 000.00 | 13 791 201.20 | 0.39 |
| EUR | SWISSPORT INVESTMENTS SA-REG-S-SUB 9.75000% 15-15.12.22 | 15 780 000.00 | 15 939 693.60 | 0.45 |
| EUR | SYNLAB UNSECURED BONDCO PLC-REG-S 8.25000% 15-01.07.23 | 18 535 000.00 | 19 719 015.80 | 0.56 |
| EUR | TELENET FINANCE VI LUXEMBOURG SCA-REG-S 4.87500% 15-15.07.27 | 13 180 000.00 | 13 846 644.40 | 0.39 |
| EUR | THOMAS COOK FINANCE PLC-REG-S 6.75000% 15-15.06.21 | 10 990 000.00 | 11 217 602.90 | 0.32 |
| EUR | TITAN GLOBAL FINANCE PLC-REG-S 3.50000% 16-17.06.21 | 7 580 000.00 | 7 693 700.00 | 0.22 |
| EUR | TMF GROUP HOLDING BV-REG-S 9.87500% 12-01.12.19 | 5 440 000.00 | 5 780 979.20 | 0.16 |
| EUR | TRINSEO MATERIALS OPERATING/FIN-REG-S 6.37500% 15-01.05.22 | 15 390 000.00 | 16 160 731.20 | 0.46 |
| EUR | UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 6.95000% 12-31.10.22 | 10 215 000.00 | 11 514 450.15 | 0.33 |
| EUR | UNITYMEDIA KABELBW GMBH-REG-S 3.75000% 15-15.01.27 | 12 420 000.00 | 11 881 468.80 | 0.34 |
| EUR | UNITYMEDIA NRW/HESSEN-REG-S 4.00000% 14-15.01.25 | 19 230 000.00 | 19 765 555.50 | 0.56 |
| EUR | UNITYMEDIA NRW/HESSEN-REG-S 3.50000% 15-15.01.27 | 8 820 000.00 | 8 686 553.40 | 0.25 |
| EUR | UNITYMEDIA NRW/HESSEN-REG-S 4.62500% 15-15.02.26 | 13 200 000.00 | 13 991 208.00 | 0.40 |
| EUR | UNIVEG HOLDING BV-REG-S 7.87500% 13-15.11.20 | 4 360 000.00 | 4 514 605.60 | 0.13 |
| EUR | UPCB FINANCE IV LTD-REG-S 4.00000% 15-15.01.27 | 5 955 000.00 | 5 902 000.50 | 0.17 |
| EUR | VALLOUREC SA-REG-S 2.25000% 14-30.09.24 | 6 900 000.00 | 5 475 426.00 | 0.16 |
| EUR | VERISURE HOLDING AB-REG-S 6.00000% 15-01.11.22 | 10 030 000.00 | 10 820 364.00 | 0.31 |
| EUR | VOLVO CAR AB-REG-S 3.25000% 16-18.05.21 | 3 555 000.00 | 3 731 185.80 | 0.11 |
| EUR | VOTORANTIM CIMENTOS SA-REG-S 3.25000% 14-25.04.21 | 1 120 000.00 | 1 107 635.20 | 0.03 |
| EUR | VWR FUNDING INC-REG-S 4.62500% 15-15.04.22 | 23 010 000.00 | 23 483 315.70 | 0.67 |
| EUR | WIND ACQUISITION FINANCE SA-REG-S 7.00000% 14-23.04.21 | 43 690 000.00 | 45 619 787.30 | 1.30 |
| EUR | WIND ACQUISITION FINANCE SA-REG-S 4.00000% 14-15.07.20 | 33 880 000.00 | 34 331 281.60 | 0.98 |
| EUR | WITTUR INTERNATIONAL HOLDING GMBH-REG-S 8.50000% 15-15.02.23 | 17 560 000.00 | 16 699 384.40 | 0.47 |
| EUR | WORLDPAY FINANCE PLC-REG-S 3.75000% 15-15.11.22 | 10 355 000.00 | 11 097 557.05 | 0.31 |
| EUR | ZF NORTH AMERICA CAPITAL INC 2.75000% 15-27.04.23 | 10 300 000.00 | 10 952 299.00 | 0.31 |
| **Total EUR** | | | **961 688 588.59** | **27.33** |
| **GBP** | | | | |
| GBP | 1ST CREDIT HOLDINGS 11.00000% 13-10.06.20 | 7 020 000.00 | 7 676 236.94 | 0.22 |
| GBP | AA BOND CO LTD-REG-S 5.50000% 15-31.07.22 | 9 470 000.00 | 10 819 719.97 | 0.31 |
| GBP | CABOT FINANCIAL LUXEMBOURG SA-REG-S 6.50000% 14-01.04.21 | 5 230 000.00 | 5 905 405.08 | 0.17 |
| GBP | COGNITA FINANCING PLC-REG-S 7.75000% 15-15.08.21 | 6 875 000.00 | 8 277 953.50 | 0.24 |
| GBP | GALAXY BIDCO LTD-REG-S 6.37500% 13-15.11.20 | 1 650 000.00 | 1 939 142.41 | 0.05 |
| GBP | GALAXY FINCO LTD-REG-S 7.87500% 13-15.11.21 | 7 540 000.00 | 8 555 989.84 | 0.24 |
| GBP | GARFUNKELUX HOLDCO 3 SA-REG-S 8.50000% 15-01.11.22 | 3 885 000.00 | 4 583 986.17 | 0.13 |
| GBP | NEW LOOK SENIOR ISSUER PLC-REG-S 6.50000% 15-01.07.22 | 4 540 000.00 | 4 841 500.84 | 0.14 |
| GBP | NEW LOOK SENIOR ISSUER PLC-REG-S-SUB 8.00000% 15-01.07.23 | 4 540 000.00 | 4 363 899.99 | 0.12 |
| GBP | UNICREDIT INTL BK LUX SA 8.59250% 08-PRP | 1 550 000.00 | 1 881 226.64 | 0.05 |
| GBP | VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-REG-S 6.25000% 14-28.03.29 | 3 400 000.00 | 4 202 647.60 | 0.12 |
| GBP | VOYAGE CARE BONDCO PLC-REG-S 6.50000% 13-01.08.18 | 6 790 000.00 | 7 707 127.44 | 0.22 |
| **Total GBP** | | | **70 754 836.42** | **2.01** |
| **USD** | | | | |
| USD | SFR GROUP SA-144A 6.00000% 14-15.05.22 | 2 700 000.00 | 2 450 613.99 | 0.07 |
| **Total USD** | | | **2 450 613.99** | **0.07** |
| **Total Anleihen, fester Zins** | | | **1 034 894 039.00** | **29.41** |
| **Anleihen, variabler Zins** | | | | |
| **EUR** | | | | |
| EUR | ACCOR SA-REG-S-SUB 4.125%/VAR 14-PRP | 7 900 000.00 | 7 930 652.00 | 0.22 |
| EUR | ARKEMA SA-REG-S-SUB 4.750%/VAR 14-PRP | 11 800 000.00 | 12 529 358.00 | 0.36 |
| EUR | BANCA INTESA SPA-SUBS 8.04700%3M EURIBOR+410BP 08-PRP | 13 000 000.00 | 13 925 340.00 | 0.40 |
| EUR | BANCO BILBALO VIZCAYA ARGENT-REG-S-SUB 7.000%/VAR 14-PRP | 200 000.00 | 186 824.00 | 0.01 |
| EUR | BANCO BILBALO VIZCAYA ARGENT-SUB-REG-S 6.750%/VAR 15-PRP | 8 400 000.00 | 7 783 356.00 | 0.22 |
| EUR | BANCO POPULAR ESPAN-SUB 5.702%/3M EURIBOR+360BP 09-22.12.19 | 2 000 000.00 | 1 919 460.00 | 0.05 |
| EUR | BANK OF IRELAND-REG-S-SUB 7.375%/VAR 15-PRP | 5 130 000.00 | 4 888 479.60 | 0.14 |
| EUR | CAIXA SABADELL PREFERENTES SAU-SUB 3M EURIBOR+195 BP 06-PRP | 10 200 000.00 | 7 191 000.00 | 0.20 |
| EUR | CREDIT AGRICOLE SA REG-S-SUB 6.500%/VAR 14-PRP | 1 680 000.00 | 1 673 061.60 | 0.05 |
| EUR | CREDIT LOGEMENT SA-SUB 4.60400%/3M EURIBOR+115BP 06-PRP | 18 150 000.00 | 14 060 623.50 | 0.40 |
| EUR | DEUTSCHE POSTBANK-SUB 5.983%/3M EURIBOR+207BP 07-PRP | 17 200 000.00 | 16 320 908.00 | 0.46 |
| EUR | EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA-REG-S-SUB 5.375%/VAR 15-16.09.75 | 9 500 000.00 | 9 683 255.00 | 0.27 |
| EUR | ENEL SPA-REG-S-SUB 5.000%/VAR 14-15.01.75 | 1 590 000.00 | 1 690 090.50 | 0.05 |
| EUR | ENEL SPA-SUB 6.500%/VAR 13-10.01.74 | 6 120 000.00 | 6 611 680.80 | 0.19 |
| EUR | GAS NATURAL FENOSA FINANCE BV-REG-S-SUB 4.12500% 14-PRP | 13 500 000.00 | 13 849 245.00 | 0.39 |
| EUR | GROUPAMA SA-REG-S-SUB 6.375%/3M EURIBOR+577BP 14-PRP | 900 000.00 | 829 773.00 | 0.02 |
| EUR | HYPO REAL ES INTL-SUB 5.86400%/3M EURIBOR+213 BP 07-PRP | 15 500 000.00 | 15 209 375.00 | 0.43 |
| EUR | IBERCAJA BANCO SA 5.000%/VAR REG-S-SUB 15-28.07.25 | 7 700 000.00 | 7 140 441.00 | 0.20 |
| EUR | KBC GROEP NV-REG-S-SUB 5.625%/VAR 14-PRP | 9 585 000.00 | 9 343 266.30 | 0.27 |
| EUR | KONINKLIJKE KPN NV-REG-S-SUB 6.125%/VAR 13-PRP | 4 250 000.00 | 4 563 947.50 | 0.13 |
| EUR | LA MONDIALE SAM-REG-S-SUB 5.050%/VAR 14-PRP | 2 780 000.00 | 2 748 808.40 | 0.08 |
| EUR | LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S-SUB 6.375%/VAR 14-PRP | 5 551 000.00 | 5 598 183.50 | 0.16 |
| EUR | ORIGIN ENERGY FINANCE LTD-REG-S-SUB 4.000%/VAR 14-16.09.74 | 11 680 000.00 | 11 182 665.60 | 0.32 |
| EUR | PERMANENT TSB PLC-REG-S-SUB 8.625%/VAR 15-PRP | 7 400 000.00 | 6 508 522.00 | 0.19 |
| EUR | PROMONTORIA MCS SAS-REG-S 3M EURIBOR+575BP 16-30.09.21 | 3 675 000.00 | 3 714 763.50 | 0.11 |
| EUR | REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV-SUB-REG-S 3.875%/VAR 15-PRP | 6 370 000.00 | 6 158 516.00 | 0.18 |
| EUR | REPSOL INTERNATIONAL FINANC-REG-S-SUB 4.500%/VAR 15-25.03.75 | 9 950 000.00 | 9 300 165.50 | 0.26 |
| EUR | ROYAL BANK OF SCOT GP PLC 7.09160%/3M EURIBOR+233BP 07-PRP | 7 350 000.00 | 7 276 353.00 | 0.21 |

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in EUR NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|
| EUR | SCHUMANN SPA-REG-S 3M EURIBOR+662.5BP 16-31.07.22 | 2 308 000.00 | 2 302 230.00 | 0.07 |
| EUR | SOCIETE GENERALE-SUB 9.375%/3M EURIBOR+890.1BP 09-PRP | 2 850 000.00 | 3 453 487.50 | 0.10 |
| EUR | SOLVAY FINANCE SA-REG-S-SUB 5.118%/VAR 15-PRP | 6 440 000.00 | 6 823 759.60 | 0.19 |
| EUR | SOLVAY FINANCE SA-REG-S-SUB 5.869%/VAR 15-PRP | 15 620 000.00 | 17 025 956.20 | 0.48 |
| EUR | TDC A/S-REG-S-SUB 3.500%/VAR 15-26.02.3015 | 13 600 000.00 | 13 036 824.00 | 0.37 |
| EUR | TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 7.625%/VAR 13-PRP | 7 700 000.00 | 8 939 238.00 | 0.25 |
| EUR | TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 5.000%/VAR 14-PRP | 8 200 000.00 | 8 532 264.00 | 0.24 |
| EUR | TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 5.875%/VAR 14-PRP | 10 000 000.00 | 10 795 900.00 | 0.31 |
| EUR | TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 4.200%/VAR 14-PRP | 9 000 000.00 | 9 240 120.00 | 0.26 |
| EUR | TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 3.750%/VAR 16-PRP | 3 000 000.00 | 2 982 630.00 | 0.08 |
| EUR | UBS GROUP AG-REG-S-SUB 5.750%/VAR 15-PRP | 5 535 000.00 | 5 711 455.80 | 0.16 |
| EUR | UNICREDIT LUX FINANCE SA-SUB 8.125%/3M EURIBOR+665BP 09-PRP | 29 526 000.00 | 32 769 726.36 | 0.93 |
| EUR | VOLVO TREASURY AB-REG-S-SUB 4.200%/VAR 14-10.06.75 | 12 175 000.00 | 12 573 122.50 | 0.36 |
| EUR | WIENERBERGER AG-SUB 6.500%/VAR 14-PRP | 8 835 000.00 | 9 301 576.35 | 0.26 |
| **Total EUR** | | | **353 306 404.61** | **10.03** |
| **GBP** | | | | |
| GBP | BANK OF SCOTLAND-REG-S-SUB 7.754%/VAR 00-PRP | 2 160 000.00 | 2 858 071.86 | 0.08 |
| GBP | CREDIT AGRICOLE SA-REG-S-SUB 7.500%/VAR 14-PRP | 700 000.00 | 797 000.88 | 0.02 |
| GBP | CREDIT AGRICOLE SA-SUB 7.58900%/3M LIBOR+355BP-PRP | 4 850 000.00 | 6 174 965.49 | 0.18 |
| GBP | CREDIT AGRICOLE SA-SUB 8.12500%/3M LIBOR+646BP 09-PRP | 4 400 000.00 | 5 758 169.47 | 0.16 |
| GBP | ENEL SPA-SUB 6.625%/VAR 14-15.09.76 | 2 890 000.00 | 3 612 003.01 | 0.10 |
| GBP | GALAXY BIDCO LTD-REG-S 3M LIBOR+500BP 13-15.11.19 | 340 000.00 | 391 543.89 | 0.01 |
| GBP | HBOS CAPITAL FUNDING LP-SUB 6.46100%/VAR 01-PRP | 3 665 000.00 | 4 541 687.46 | 0.13 |
| GBP | LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S-SUB 7.000%/VAR 14-PRP | 2 900 000.00 | 3 312 352.90 | 0.10 |
| **Total GBP** | | | **27 445 794.96** | **0.78** |
| **USD** | | | | |
| USD | BAYERNLB CAPITAL TRUST I-SUB 6.20320%/3M LIBOR+198BP 07-PRP | 12 700 000.00 | 11 159 681.44 | 0.32 |
| USD | ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC 7.64800%/VAR 01-PRP | 9 370 000.00 | 9 984 494.57 | 0.28 |
| USD | UBS GROUP AG-REG-S-SUB 7.125%/VAR 15-PRP | 11 070 000.00 | 9 975 608.65 | 0.28 |
| USD | UBS GROUP AG-REG-S-SUB 7.000%/VAR 15-PRP | 3 575 000.00 | 3 361 161.69 | 0.10 |
| **Total USD** | | | **34 480 946.35** | **0.98** |
| **Total Anleihen, variabler Zins** | | | **415 233 145.92** | **11.79** |
| **Wandelanleihen, variabler Zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | BARCLAYS PLC-REG-S-SUB 7.875%/VAR 16-PRP | 5 409 000.00 | 4 757 494.18 | 0.14 |
| **Total USD** | | | **4 757 494.18** | **0.14** |
| **Total Wandelanleihen, variabler Zins** | | | **4 757 494.18** | **0.14** |
| **Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden** | | | **3 027 570 850.74** | **86.03** |

## Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Mortgage Backed Securities, fester Zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | JP MORGAN CHASE COMRCL MTG SEC-144A-SUB 3.74200% 15-01.09.32 | 5 000 000.00 | 4 117 033.28 | 0.12 |
| **Total USD** | | | **4 117 033.28** | **0.12** |
| **Total Mortgage Backed Securities, fester Zins** | | | **4 117 033.28** | **0.12** |
| **Mortgage Backed Securities, variabler Zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | ALADDIN CDO I LTD-REG-S *DEFAULT* 3M LIBOR+750BP 06-31.10.16* | 1 700 000.00 | 0.01 | 0.00 |
| USD | BAMLL COMRCIAL MRTG SEC TRT 2014-IN-144A-SUB FLR 14-15.12.29 | 10 000 000.00 | 8 481 934.51 | 0.24 |
| USD | BXHTL MORT TRST-144A-SUB 1M LIBOR+357.418BP 15-15.05.29 | 13 750 000.00 | 11 623 509.52 | 0.33 |
| USD | CSMC TRUST 2015-DEAL-144A-SUB 1M LIBOR+400BP 15-15.04.29 | 14 000 000.00 | 12 307 000.35 | 0.35 |
| USD | CSMC TRUST 2015-SAND MZ-SUB-144A 1M LIBOR+385BP 15-15.08.30 | 4 000 000.00 | 3 441 825.59 | 0.10 |
| USD | HILT 2014-ORL MORTGAGE TRUST-144A 1M LIBOR+325BP 14-15.07.29 | 5 300 000.00 | 4 527 065.88 | 0.13 |
| USD | HYATT HTL PRTFLO TRT 2014-144A 1M LIBOR+622.45BP 14-15.11.16 | 10 000 000.00 | 8 864 979.54 | 0.25 |
| USD | JP MORGAN CHASE COM MTGE-144A-SUB 1M LIBOR+385BP 14-15.10.29 | 10 000 000.00 | 8 537 379.43 | 0.24 |
| USD | JPM CHASE COMM MORT SEC-144A-SUB 1M LIBOR+395BP 15-15.01.32 | 14 000 000.00 | 12 420 718.28 | 0.35 |
| USD | WFCG COMM MTG TRUST-144A-SUB 1M LIBOR+372.03BP 15-15.11.29 | 11 000 000.00 | 7 568 925.54 | 0.22 |
| **Total USD** | | | **77 773 338.65** | **2.21** |
| **Total Mortgage Backed Securities, variabler Zins** | | | **77 773 338.65** | **2.21** |
| **Notes, fester Zins** | | | | |
| **EUR** | | | | |
| EUR | ARD FINANCE SA-REG-S (PIK) 6.62500% 16-15.09.23 | 19 582 000.00 | 18 847 675.00 | 0.54 |
| EUR | INFOR US INC 5.75000% 16-15.05.22 | 14 730 000.00 | 14 266 005.00 | 0.40 |
| EUR | PLAY TOPCO SA-REG-S (PIK) 7.75000% 14-28.02.20 | 13 810 000.00 | 14 035 517.30 | 0.40 |
| **Total EUR** | | | **47 149 197.30** | **1.34** |
| **USD** | | | | |
| USD | ADT CORP 6.25000% 14-15.10.21 | 1 653 000.00 | 1 599 606.25 | 0.05 |
| USD | AMERICAN AXLE & MANUFACTURING INC 6.62500% 12-15.10.22 | 2 930 000.00 | 2 757 140.95 | 0.08 |
| USD | BEVERAGE PACKAGING HOLDING II-144A 5.62500% 13-15.12.16 | 1 000 000.00 | 887 702.43 | 0.02 |
| USD | COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC 8.25000% 15-15.10.23 | 14 900 000.00 | 13 914 754.40 | 0.40 |
| USD | FRONTIER COMMUNICATIONS CORP 11.00000% 16-15.09.25 | 9 602 000.00 | 8 918 034.80 | 0.25 |
| USD | NCR CORP 6.37500% 14-15.12.23 | 8 265 000.00 | 7 777 395.89 | 0.22 |

* Siehe Erläuterung 8

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in EUR NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|
| USD | NOVA CHEMICALS CORP-144A 5.25000% 13-01.08.23 | 8 265 000.00 | 7 519 987.99 | 0.21 |
| USD | QORVO INC 6.75000% 16-01.12.23 | 9 975 000.00 | 9 575 130.14 | 0.27 |
| USD | QUICKEN LOANS INC -144A 5.75000% 15-01.05.25 | 16 210 000.00 | 14 316 092.72 | 0.41 |
| USD | STEEL DYNAMICS INC 5.25000% 13-15.04.23 | 8 265 000.00 | 7 630 305.66 | 0.22 |
| USD | WR GRACE & CO-CONN-144A 5.62500% 14-01.10.24 | 12 000 000.00 | 11 612 386.54 | 0.33 |
| **Total USD** | | | **86 508 537.77** | **2.46** |
| **Total Notes, fester Zins** | | | **133 657 735.07** | **3.80** |
| **Notes, variabler Zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | CHASE CAPITAL II-SUB 3M LIBOR+50BP 997-01.02.27 | 22 430 000.00 | 17 539 030.52 | 0.50 |
| **Total USD** | | | **17 539 030.52** | **0.50** |
| **Total Notes, variabler Zins** | | | **17 539 030.52** | **0.50** |
| **Medium-Term Notes, variabler Zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | INTESA SANPAOLO SPA-144A-SUB 7.700%/VAR 15-PRP | 4 025 000.00 | 3 133 898.38 | 0.09 |
| **Total USD** | | | **3 133 898.38** | **0.09** |
| **Total Medium-Term Notes, variabler Zins** | | | **3 133 898.38** | **0.09** |
| **Anleihen, fester Zins** | | | | |
| **EUR** | | | | |
| EUR | NEWELL BRANDS INC-REG-S 3.75000% 16-01.10.21 | 5 210 000.00 | 5 809 045.80 | 0.17 |
| **Total EUR** | | | **5 809 045.80** | **0.17** |
| **Total Anleihen, fester Zins** | | | **5 809 045.80** | **0.17** |
| **Anleihen, variabler Zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | CREDIT AGRICOLE SA-REG-S-SUB 8.125%/VAR 13-19.09.33 | 4 453 000.00 | 4 274 491.68 | 0.12 |
| USD | JP MORGAN CHASE CAPITAL XIII-SUB 3M LIBOR+95BP 04-30.09.34 | 165 000.00 | 120 334.89 | 0.00 |
| USD | PNC CAPITAL TRUST C-SUB 3M LIBOR+57BP 998-01.06.28 | 13 845 000.00 | 11 580 619.33 | 0.33 |
| **Total USD** | | | **15 975 445.90** | **0.45** |
| **Total Anleihen, variabler Zins** | | | **15 975 445.90** | **0.45** |
| **Weitere Anleihen, variabler Zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | STATE STREET CAPITAL TRUST I-SUB 3M LIBOR+56BP 98-15.05.28 | 10 729 000.00 | 8 592 365.19 | 0.24 |
| **Total USD** | | | **8 592 365.19** | **0.24** |
| **Total Weitere Anleihen, variabler Zins** | | | **8 592 365.19** | **0.24** |
| **Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | **266 597 892.79** | **7.58** |

## Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht an einer offiziellen Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Mortgage Backed Securities, fester Zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | COMM 2015-CCRE23 MORTGAGE TRUS-144A-SUB 3.80700% 15-01.04.30 | 12 000 000.00 | 9 931 973.31 | 0.28 |
| **Total USD** | | | **9 931 973.31** | **0.28** |
| **Total Mortgage Backed Securities, fester Zins** | | | **9 931 973.31** | **0.28** |
| **Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht an einer offiziellen Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | **9 931 973.31** | **0.28** |

## OGAW/Andere OGA im Sinne des Artikels 41 (1) e) des abgeänderten luxemburgischen Gesetzes vom 17. Dezember 2010

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Investment Fonds, open end** | | | | |
| **Irland** | | | | |
| GBP | UBS (IRL) SELECT MONEY MARKET FUND-GBP-S-DIST | 3 000.00 | 34 676 988.78 | 0.98 |
| USD | UBS IRL SELECT MONEY MARKET FUND - USD-S-DIST | 7 331.85 | 65 241 546.54 | 1.85 |
| **Total Irland** | | | **99 918 535.32** | **2.83** |
| **Total Investment Fonds, open end** | | | **99 918 535.32** | **2.83** |
| **Total OGAW/Andere OGA im Sinne des Artikels 41 (1) e) des abgeänderten luxemburgischen Gesetzes vom 17. Dezember 2010** | | | **99 918 535.32** | **2.83** |
| **Total des Wertpapierbestandes** | | | **3 404 019 252.16** | **96.72** |

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in EUR NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|

## Derivative Instrumente

### Derivative Instrumente, die nicht an einer offiziellen Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

**Credit-Default-Swaps***

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| EUR | JPMORGAN/TRIONISTA HOLDCO CREDIT DEFAULT SWAPS PAYER 5.00000% 15-20.12.20 | -5 000 000.00 | -810 021.44 | -0.02 |
| EUR | JPMORGAN/TRIONISTA HOLDCO CREDIT DEFAULT SWAPS PAYER 5.00000% 15-20.12.20 | -5 000 000.00 | -810 021.44 | -0.02 |
| EUR | MERRILL LYNCH/COFP CREDIT DEFAULT SWAPS REC 1.00000% 16-20.06.21 | 5 000 000.00 | -349 539.61 | -0.01 |
| EUR | MERRILL LYNCH/COFP CREDIT DEFAULT SWAPS REC 1.00000% 16-20.06.21 | 5 000 000.00 | -349 539.61 | -0.01 |
| **Total Credit-Default-Swaps** | | | **-2 319 122.10** | **-0.06** |
| **Total Derivative Instrumente, die nicht an einer offiziellen Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | **-2 319 122.10** | **-0.06** |
| **Total Derivative Instrumente** | | | **-2 319 122.10** | **-0.06** |

### Devisenterminkontrakte

**Devisenterminkontrakte (Kauf/Verkauf)**

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| EUR | 501 670 262.22 | USD | 563 915 000.00 | 19.10.2016 | 294 479.12 | 0.01 |
| EUR | 314 008 835.31 | GBP | 266 125 000.00 | 19.10.2016 | 6 532 909.30 | 0.19 |
| CHF | 110 875 100.00 | EUR | 101 361 418.61 | 19.10.2016 | 433 021.63 | 0.01 |
| USD | 1 219 406 600.00 | EUR | 1 084 808 931.79 | 19.10.2016 | -636 779.98 | -0.02 |
| AUD | 245 419 200.00 | EUR | 163 701 526.23 | 19.10.2016 | 3 212 672.95 | 0.09 |
| CAD | 63 308 300.00 | EUR | 42 979 770.93 | 19.10.2016 | -144 982.92 | 0.00 |
| CNH | 285 469 600.00 | EUR | 37 786 709.89 | 19.10.2016 | 196 208.35 | 0.00 |
| HKD | 595 352 600.00 | EUR | 68 291 892.28 | 19.10.2016 | -32 262.14 | 0.00 |
| SGD | 242 894 000.00 | EUR | 158 669 831.87 | 19.10.2016 | -258 000.50 | -0.01 |
| GBP | 28 416 300.00 | EUR | 33 529 241.02 | 19.10.2016 | -697 571.10 | -0.02 |
| EUR | 1 542 374.19 | HKD | 13 470 800.00 | 19.10.2016 | -2 108.57 | 0.00 |
| EUR | 21 189 486.99 | USD | 23 838 300.00 | 19.10.2016 | -5 101.43 | 0.00 |
| EUR | 2 378 090.36 | CNH | 17 902 200.00 | 19.10.2016 | -3 871.85 | 0.00 |
| EUR | 836 798.53 | HKD | 7 261 100.00 | 19.10.2016 | 4 283.48 | 0.00 |
| EUR | 3 171 375.76 | SGD | 4 835 200.00 | 19.10.2016 | 17 930.69 | 0.00 |
| EUR | 662 394.09 | GBP | 566 700.00 | 19.10.2016 | 7 639.34 | 0.00 |
| EUR | 2 806 959.10 | AUD | 4 162 100.00 | 19.10.2016 | -23 763.14 | 0.00 |
| EUR | 1 108 347.67 | HKD | 9 585 700.00 | 19.10.2016 | 9 307.64 | 0.00 |
| EUR | 11 433 074.64 | USD | 12 781 400.00 | 19.10.2016 | 69 155.55 | 0.00 |
| EUR | 1 367 856.34 | CHF | 1 490 300.00 | 19.10.2016 | -388.24 | 0.00 |
| EUR | 1 110 196.48 | AUD | 1 640 000.00 | 19.10.2016 | -5 198.27 | 0.00 |
| EUR | 206 700.60 | CNH | 1 560 000.00 | 19.10.2016 | -863.89 | 0.00 |
| EUR | 2 482 373.32 | SGD | 3 807 000.00 | 19.10.2016 | -495.10 | 0.00 |
| EUR | 980 516.03 | GBP | 845 900.00 | 19.10.2016 | 3 178.74 | 0.00 |
| EUR | 1 163 499.29 | HKD | 10 121 100.00 | 19.10.2016 | 3 073.45 | 0.00 |
| GBP | 22 455 000.00 | EUR | 26 039 552.75 | 19.10.2016 | -95 459.11 | 0.00 |
| EUR | 10 630 479.27 | USD | 11 933 000.00 | 19.10.2016 | 20 871.05 | 0.00 |
| EUR | 1 287 282.70 | HKD | 11 198 600.00 | 19.10.2016 | 3 317.04 | 0.00 |
| EUR | 354 571.70 | GBP | 305 900.00 | 19.10.2016 | 1 140.47 | 0.00 |
| **Total Devisenterminkontrakte (Kauf/Verkauf)** | | | | | **8 902 342.56** | **0.25** |

| | | |
|---|---|---|
| **Bankguthaben, Sicht- und Fristgelder und andere liquide Mittel** | **80 446 476.13**** | **2.29** |
| **Andere Aktiva und Passiva** | **28 267 209.49** | **0.80** |
| **Total des Nettovermögens** | **3 519 316 158.24** | **100.00** |

* Nominal positiv: der Subfonds ist «Receiver», Nominal negativ: der Subfonds ist «Payer».
** Zum 30. September 2016 wurden gegenüber JP Morgan Chase London Bankguthaben in Höhe von EUR 1 700 000 und Merill Lynch Bankguthaben in Höhe von EUR 700 000 als Sicherheit eingesetzt.

# UBS (Lux) Bond Fund – Full Cycle Asian Bond (USD)

## Wichtigste Daten

| | ISIN | 30.9.2016 | 31.3.2016 | 31.3.2015 |
|---|---|---|---|---|
| Nettovermögen in USD | | 371 163 793.00 | 368 171 152.59 | 371 780 995.99 |
| **Klasse F-acc** | **LU0464245496** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 104 989.0210 | 360 520.4160 | 511 979.5670 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in USD | | 149.22 | 141.49 | 134.99 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in USD[1] | | 149.22 | 141.49 | 134.99 |
| **Klasse (EUR hedged) F-acc** | **LU0464251627** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 15 036.1220 | 18 036.1220 | 46 231.3610 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 145.40 | 138.82 | 133.61 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 145.40 | 138.82 | 133.61 |
| **Klasse (SGD hedged) F-acc[2]** | **LU0964819261** | | | |
| Anteile im Umlauf | | - | 20 698.0000 | 38 529.0000 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in SGD | | - | 119.19 | 113.06 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in SGD[1] | | - | 119.19 | 113.06 |
| **Klasse I-A1-acc** | **LU0464245819** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 77 297.5260 | 159 695.9710 | 111 343.8340 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in USD | | 130.97 | 124.37 | 119.03 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in USD[1] | | 130.97 | 124.37 | 119.03 |
| **Klasse I-X-acc** | **LU0464246890** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 124 088.3750 | 170 174.3750 | 162 103.2540 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in USD | | 149.75 | 141.72 | 134.72 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in USD[1] | | 149.75 | 141.72 | 134.72 |
| **Klasse I-X-dist** | **LU0464246627** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 147 175.1610 | 121 237.6540 | 146 338.8700 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in USD | | 107.56 | 106.13 | 101.44 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in USD[1] | | 107.56 | 106.13 | 101.44 |
| **Klasse (EUR hedged) N-acc** | **LU0464250819** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 10 339.9880 | 7 340.7040 | 8 650.4140 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 124.60 | 119.72 | 116.71 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 124.60 | 119.72 | 116.71 |
| **Klasse P-acc** | **LU0464244333** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 693 258.5420 | 598 974.9870 | 693 985.1120 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in USD | | 142.54 | 135.95 | 131.23 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in USD[1] | | 142.54 | 135.95 | 131.23 |
| **Klasse (EUR hedged) P-acc** | **LU0464250652** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 301 448.0200 | 284 435.6520 | 382 670.7690 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 140.70 | 135.02 | 131.28 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 140.70 | 135.02 | 131.28 |
| **Klasse (SGD hedged) P-acc** | **LU0464247518** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 17 282.4310 | 122 158.8400 | 141 969.7180 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in SGD | | 138.15 | 131.72 | 126.23 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in SGD[1] | | 138.15 | 131.72 | 126.23 |
| **Klasse (EUR hedged) P-dist** | **LU0464250496** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 112 743.7640 | 124 143.5810 | 166 037.8080 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 111.29 | 109.64 | 110.82 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 111.29 | 109.64 | 110.82 |
| **Klasse P-mdist** | **LU0464244259** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 790 137.2470 | 394 485.5270 | 441 416.1520 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in USD | | 100.25 | 97.65 | 98.68 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in USD[1] | | 100.25 | 97.65 | 98.68 |
| **Klasse (SGD hedged) P-mdist** | **LU0464247435** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 139 060.4350 | 139 589.4360 | 284 161.1670 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in SGD | | 100.15 | 97.77 | 98.57 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in SGD[1] | | 100.15 | 97.77 | 98.57 |
| **Klasse Q-acc[3]** | **LU0464245652** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 474 294.3870 | 490 424.7310 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in USD | | 109.07 | 103.66 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in USD[1] | | 109.07 | 103.66 | - |
| **Klasse (EUR hedged) Q-acc[4]** | **LU0464251973** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 19 445.0880 | 12 534.0500 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 109.45 | 104.66 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 109.45 | 104.66 | - |

[1] Siehe Erläuterung 1
[2] Die Anteilsklasse (SGD hedged) F-acc war bis zum 16.9.2016 im Umlauf
[3] Erste NAV 18.5.2015
[4] Erste NAV 11.9.2015

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Klasse (EUR hedged) Q-dist[4]** | **LU0464251890** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 5 977.6410 | 4 460.1700 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 107.52 | 104.66 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[1] | | 107.52 | 104.66 | - |
| **Klasse Q-mdist[5]** | **LU0464245579** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 4 292.1130 | 4 392.1130 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in USD | | 105.44 | 102.36 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in USD[1] | | 105.44 | 102.36 | - |

[1] Siehe Erläuterung 1
[4] Erste NAV 11.9.2015
[5] Erste NAV 22.10.2015

## Struktur des Wertpapierbestandes

| **Geographische Aufteilung in % des Nettovermögens** | |
|---|---|
| Britische Jungferninseln | 16.42 |
| Südkorea | 10.63 |
| Cayman-Inseln | 7.84 |
| Singapur | 6.38 |
| Hongkong | 5.46 |
| Indonesien | 5.09 |
| China | 4.95 |
| Kanada | 4.21 |
| Luxemburg | 4.20 |
| Indien | 3.76 |
| Vereinigte Staaten | 3.42 |
| Philippinen | 3.18 |
| Australien | 2.73 |
| Malaysia | 2.56 |
| Niederlande | 2.35 |
| Sri Lanka | 1.61 |
| Grossbritannien | 1.50 |
| Neuseeland | 1.50 |
| Mexiko | 1.28 |
| Katar | 1.21 |
| Jersey | 0.70 |
| Mauritius | 0.63 |
| Vietnam | 0.29 |
| **Total** | **91.90** |

| **Wirtschaftliche Aufteilung in % des Nettovermögens** | |
|---|---|
| Finanz- & Beteiligungsgesellschaften | 21.27 |
| Banken & Kreditinstitute | 18.17 |
| Länder- & Zentralregierungen | 7.87 |
| Erdöl | 6.09 |
| Verkehr & Transport | 5.27 |
| Immobilien | 5.09 |
| Energie- & Wasserversorgung | 4.38 |
| Anlagefonds | 4.20 |
| Diverse Dienstleistungen | 4.01 |
| Baugewerbe & Baumaterial | 3.01 |
| Bergbau, Kohle & Stahl | 2.39 |
| Versicherungen | 1.88 |
| Diverse nicht klassierte Gesellschaften | 1.65 |
| Computer & Netzwerkausrüster | 1.53 |
| Internet, Software & IT-Dienste | 1.44 |
| Öffentlich-rechtliche Körperschaften | 1.31 |
| Tabak & alkoholische Getränke | 1.15 |
| Elektrische Geräte & Komponenten | 0.72 |
| Pfandbriefinstitute & Refinanzierungsgesellschaften | 0.47 |
| **Total** | **91.90** |

## Nettovermögensaufstellung

| | | USD |
|---|---|---|
| **Aktiva** | | **30.9.2016** |
| Wertpapierbestand, Einstandswert | 332 336 498.82 | |
| Wertpapierbestand, nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) | 8 756 387.45 | |
| Total Wertpapierbestand (Erläuterung 1) | | 341 092 886.27 |
| Bankguthaben, Sicht- und Fristgelder | | 23 511 349.40 |
| Andere liquide Mittel (Margins) | | 439 910.00 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen (Erläuterung 1) | | 6 405 587.50 |
| Forderungen aus Zeichnungen | | 494 454.85 |
| Zinsforderungen aus Wertpapieren | | 3 349 005.37 |
| Nicht realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten (Erläuterung 1) | | -133 312.50 |
| Nicht realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Devisenterminkontrakten (Erläuterung 1) | | -671 286.13 |
| **Total Aktiva** | | **374 488 594.76** |
| | | |
| **Passiva** | | |
| Zinsverbindlichkeiten aus Kontokorrentkredit | | -59.33 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen (Erläuterung 1) | | -2 136 653.33 |
| Verbindlichkeiten aus Rücknahmen | | -965 316.19 |
| Rückstellungen für pauschale Verwaltungskommission (Erläuterung 2) | -180 275.37 | |
| Rückstellungen für Abonnementsabgabe (Erläuterung 3) | -38 442.80 | |
| Rückstellungen für sonstige Kommissionen und Gebühren (Erläuterung 2) | -4 054.74 | |
| Total Rückstellungen für Aufwendungen | | -222 772.91 |
| **Total Passiva** | | **-3 324 801.76** |
| | | |
| **Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode** | | **371 163 793.00** |

## Ertrags- und Aufwandsrechnung

| | USD |
|---|---|
| **Erträge** | **1.4.2016-30.9.2016** |
| Zinsertrag auf liquide Mittel | 6 136.74 |
| Zinsen auf Wertpapiere | 6 849 316.33 |
| Erträge aus Securities Lending (Erläuterung 11) | 250 628.64 |
| Sonstige Erträge | 210 977.36 |
| **Total Erträge** | **7 317 059.07** |
| | |
| **Aufwendungen** | |
| Kosten aus Securities Lending (Erläuterung 11) | -100 251.45 |
| Pauschale Verwaltungskommission (Erläuterung 2) | -2 143 936.76 |
| Abonnementsabgabe (Erläuterung 3) | -76 565.93 |
| Sonstige Kommissionen und Gebühren (Erläuterung 2) | -20 792.84 |
| Zinsaufwand auf liquide Mittel und Kontokorrentkredit | -63.34 |
| **Total Aufwendungen** | **-2 341 610.32** |
| | |
| **Nettoerträge (-verluste) aus Anlagen** | **4 975 448.75** |
| | |
| **Realisierte Gewinne (Verluste) (Erläuterung 1)** | |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus marktbewerteten Wertpapieren ausser Optionen | 6 929 441.81 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Optionen | -82 659.00 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten | 570 567.76 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Devisenterminkontrakten | 1 709 808.80 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Swaps | -707 274.49 |
| Realisierter Währungsgewinn (-verlust) | -111 538.25 |
| **Total der realisierten Gewinne (Verluste)** | **8 308 346.63** |
| | |
| **Realisierter Nettogewinn (-verlust) der Berichtsperiode** | **13 283 795.38** |
| | |
| **Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung) (Erläuterung 1)** | |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) marktbewerteter Wertpapiere ausser Optionen | 6 629 468.31 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) von Optionen | -63 000.00 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) von Finanzterminkontrakten | -99 783.75 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) von Devisenterminkontrakten | -3 623 952.94 |
| **Total der Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung)** | **2 842 731.62** |
| | |
| **Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens infolge Geschäftstätigkeit** | **16 126 527.00** |

## Veränderungen des Nettovermögens

| | USD |
|---|---|
| | **1.4.2016-30.9.2016** |
| Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode | 368 171 152.59 |
| Zeichnungen | 129 169 934.80 |
| Rücknahmen | -139 783 491.73 |
| Total Mittelzufluss (-abfluss) | -10 613 556.93 |
| Ausbezahlte Dividende | -2 520 329.66 |
| Nettoerträge (-verluste) aus Anlagen | 4 975 448.75 |
| Total der realisierten Gewinne (Verluste) | 8 308 346.63 |
| Total der Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung) | 2 842 731.62 |
| Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens infolge Geschäftstätigkeit | 16 126 527.00 |
| **Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode** | **371 163 793.00** |

## Entwicklung der Anteile im Umlauf

| | **1.4.2016-30.9.2016** |
|---|---|
| **Klasse** | **F-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 360 520.4160 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 13 197.6530 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -268 729.0480 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **104 989.0210** |
| **Klasse** | **(EUR hedged) F-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 18 036.1220 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 0.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -3 000.0000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **15 036.1220** |
| **Klasse** | **(SGD hedged) F-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 20 698.0000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 847.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -21 545.0000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **0.0000** |
| **Klasse** | **I-A1-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 159 695.9710 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 22 993.5760 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -105 392.0210 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **77 297.5260** |
| **Klasse** | **I-X-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 170 174.3750 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 0.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -46 086.0000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **124 088.3750** |
| **Klasse** | **I-X-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 121 237.6540 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 41 529.5380 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -15 592.0310 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **147 175.1610** |
| **Klasse** | **(EUR hedged) N-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 7 340.7040 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 3 846.0460 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -846.7620 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **10 339.9880** |
| **Klasse** | **P-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 598 974.9870 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 285 599.0720 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -191 315.5170 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **693 258.5420** |
| **Klasse** | **(EUR hedged) P-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 284 435.6520 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 121 348.6670 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -104 336.2990 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **301 448.0200** |
| **Klasse** | **(SGD hedged) P-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 122 158.8400 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 5 333.9830 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -110 210.3920 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **17 282.4310** |
| **Klasse** | **(EUR hedged) P-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 124 143.5810 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 12 570.3690 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -23 970.1860 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **112 743.7640** |

| **Klasse** | **P-mdist** |
|---|---|
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 394 485.5270 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 481 527.3950 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -85 875.6750 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **790 137.2470** |
| **Klasse** | **(SGD hedged) P-mdist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 139 589.4360 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 16 476.2360 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -17 005.2370 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **139 060.4350** |
| **Klasse** | **Q-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 490 424.7310 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 79 116.1620 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -95 246.5060 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **474 294.3870** |
| **Klasse** | **(EUR hedged) Q-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 12 534.0500 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 7 065.2470 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -154.2090 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **19 445.0880** |
| **Klasse** | **(EUR hedged) Q-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 4 460.1700 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 1 617.4710 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -100.0000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **5 977.6410** |
| **Klasse** | **Q-mdist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 4 392.1130 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 934.6150 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -1 034.6150 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **4 292.1130** |

## Jährliche Ausschüttung

| **UBS (Lux) Bond Fund** | **Ex-Date** | **Pay-Date** | **Währung** | **Betrag pro Anteil** |
|---|---|---|---|---|
| – Full Cycle Asian Bond (USD) I-X-dist | 1.6.2016 | 6.6.2016 | USD | 4.40 |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) (EUR hedged) P-dist | 1.6.2016 | 6.6.2016 | EUR | 2.88 |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) (EUR hedged) Q-dist | 1.6.2016 | 6.6.2016 | EUR | 1.87 |

## Monatliche Ausschüttung

| **UBS (Lux) Bond Fund** | **Ex-Date** | **Pay-Date** | **Währung** | **Betrag pro Anteil** |
|---|---|---|---|---|
| – Full Cycle Asian Bond (USD) P-mdist | 15.4.2016 | 20.4.2016 | USD | 0.35 |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) P-mdist | 17.5.2016 | 20.5.2016 | USD | 0.35 |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) P-mdist | 15.6.2016 | 20.6.2016 | USD | 0.35 |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) P-mdist | 15.7.2016 | 20.7.2016 | USD | 0.35 |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) P-mdist | 17.8.2016 | 22.8.2016 | USD | 0.35 |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) P-mdist | 23.9.2016 | 28.9.2016 | USD | 0.35 |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) (SGD hedged) P-mdist | 15.4.2016 | 20.4.2016 | SGD | 0.39 |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) (SGD hedged) P-mdist | 17.5.2016 | 20.5.2016 | SGD | 0.39 |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) (SGD hedged) P-mdist | 15.6.2016 | 20.6.2016 | SGD | 0.39 |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) (SGD hedged) P-mdist | 15.7.2016 | 20.7.2016 | SGD | 0.39 |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) (SGD hedged) P-mdist | 17.8.2016 | 22.8.2016 | SGD | 0.39 |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) (SGD hedged) P-mdist | 23.9.2016 | 28.9.2016 | SGD | 0.39 |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) Q-mdist | 15.4.2016 | 20.4.2016 | USD | 0.37 |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) Q-mdist | 17.5.2016 | 20.5.2016 | USD | 0.37 |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) Q-mdist | 15.6.2016 | 20.6.2016 | USD | 0.37 |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) Q-mdist | 15.7.2016 | 20.7.2016 | USD | 0.37 |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) Q-mdist | 17.8.2016 | 22.8.2016 | USD | 0.37 |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) Q-mdist | 23.9.2016 | 28.9.2016 | USD | 0.37 |

# Aufstellung der Wertpapierbestände und anderer Nettovermögenswerte per 30. September 2016

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in USD NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|

## Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden

### Notes, fester zins

**USD**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| USD | ADANI TRANSMISSION LTD-REG-S 4.00000% 16-03.08.26 | 2 100 000.00 | 2 111 520.60 | 0.57 |
| USD | ALIBABA GROUP HOLDING LTD 3.12500% 15-28.11.21 | 850 000.00 | 886 289.90 | 0.24 |
| USD | BAIDU INC 3.00000% 15-30.06.20 | 2 600 000.00 | 2 671 656.00 | 0.72 |
| USD | BNZ INTERNATIONAL FUND LTD/LONDON-REG-S 2.75000% 16-02.03.21 | 5 400 000.00 | 5 555 250.00 | 1.50 |
| USD | CAIFU HOLDINGS LTD-REG-S 8.75000% 13-24.01.20 | 500 000.00 | 526 255.00 | 0.14 |
| USD | CGNPC INTERNATIONAL LTD-REG-S 4.00000% 15-19.05.25 | 3 450 000.00 | 3 705 358.65 | 1.00 |
| USD | CNPC GENERAL CAPITAL LTD-REG-S 3.40000% 13-16.04.23 | 6 150 000.00 | 6 418 201.50 | 1.73 |
| USD | COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 7.50000% 13-10.01.23 | 3 500 000.00 | 3 739 960.00 | 1.01 |
| USD | DBS BANK LTD REG-S-SUB 3.62500% 12-21.09.22 | 2 175 000.00 | 2 210 104.50 | 0.60 |
| USD | GREENKO DUTCH BV-REG-S 8.00000% 14-01.08.19 | 3 500 000.00 | 3 742 725.00 | 1.01 |
| USD | HARVEST OPERATIONS CORP-REG-S 2.12500% 13-14.05.18 | 4 015 000.00 | 4 052 295.33 | 1.09 |
| USD | HUTCHINSON WHAMPOA INTL 11 LTSD-REG-S 4.62500% 12-13.01.22 | 3 478 000.00 | 3 904 055.00 | 1.05 |
| USD | INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 12-17.01.42 | 4 000 000.00 | 4 576 288.00 | 1.23 |
| USD | INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.75000% 12-25.04.22 | 8 250 000.00 | 8 694 171.74 | 2.34 |
| USD | KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 4.75000% 11-13.07.21 | 2 455 000.00 | 2 779 911.88 | 0.75 |
| USD | KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-REG-S 3.00000% 12-19.09.22 | 2 800 000.00 | 2 971 368.40 | 0.80 |
| USD | KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 2.12500% 16-14.04.21 | 1 600 000.00 | 1 621 920.00 | 0.44 |
| USD | LISTRINDO CAPITAL BV-REG-S 6.95000% 12-21.02.19 | 300 000.00 | 310 801.20 | 0.08 |
| USD | MIE HOLDINGS CORP-REG-S 7.50000% 14-25.04.19 | 1 000 000.00 | 621 066.99 | 0.17 |
| USD | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 2.25000% 16-16.03.21 | 2 600 000.00 | 2 656 238.00 | 0.72 |
| USD | PERTAMINA PT-REG-S 4.30000% 13-20.05.23 | 5 350 000.00 | 5 611 347.50 | 1.51 |
| USD | QATAR, STATE OF-REG-S 2.37500% 16-02.06.21 | 2 300 000.00 | 2 316 675.00 | 0.62 |
| USD | RELIANCE HOLDINGS USA INC-REG-S 5.40000% 12-14.02.22 | 6 900 000.00 | 7 775 058.00 | 2.09 |
| USD | SINOPEC GROUP OVERSEAS DEV12 LTD-REG-S 3.90000% 12-17.05.22 | 9 150 000.00 | 9 861 687.00 | 2.66 |
| USD | SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMNT-REG-S 4.10000% 15-28.04.45 | 2 000 000.00 | 2 097 180.00 | 0.56 |
| USD | SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 5.75000% 16-18.01.22 | 1 200 000.00 | 1 227 144.00 | 0.33 |
| USD | STATE GRID OVERSEAS INV-REG-S 4.12500% 14-07.05.24 | 3 550 000.00 | 3 918 823.70 | 1.06 |
| USD | STUDIO CITY FINANCE LTD-REG-S 8.50000% 12-01.12.20 | 400 000.00 | 411 836.00 | 0.11 |
| USD | UNION LIFE INSURANCE CO LTD-REG-S 3.00000% 16-19.09.21 | 5 300 000.00 | 5 201 488.90 | 1.40 |
| USD | VEDANTA RESOURCES PLC-REG-S 6.00000% 13-31.01.19 | 2 000 000.00 | 1 974 780.00 | 0.53 |
| **Total USD** | | | **104 151 457.79** | **28.06** |

| | | |
|---|---|---|
| **Total Notes, fester zins** | **104 151 457.79** | **28.06** |

### Notes, variabler zins

**USD**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| USD | WOORI BANK-REG-S-SUB VAR 16-PRP | 7 000 000.00 | 6 992 853.00 | 1.89 |
| **Total USD** | | | **6 992 853.00** | **1.89** |

| | | |
|---|---|---|
| **Total Notes, variabler zins** | **6 992 853.00** | **1.89** |

### Medium-Term Notes, fester zins

**USD**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| USD | ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LDN-REG-S 2.75000% 16-03.02.21 | 3 500 000.00 | 3 598 885.50 | 0.97 |
| USD | BOC AVIATION LTD-REG-S 2.37500% 16-15.09.21 | 2 400 000.00 | 2 385 494.40 | 0.64 |
| USD | BUSAN BANK CO LTD-REG-S-SUB 3.62500% 16-25.07.26 | 2 400 000.00 | 2 416 776.00 | 0.65 |
| USD | GREENLAND HONG KONG HOLDINGS-REG-S 3.87500% 16-28.07.19 | 5 750 000.00 | 5 689 711.25 | 1.53 |
| USD | HNA GROUP INTERNATIONAL CO LTD-REG-S 6.00000% 16-18.08.19 | 4 000 000.00 | 4 043 156.00 | 1.09 |
| USD | HONGKONG ELECTRIC FINANCE LTD-REG-S 2.87500% 16-03.05.26 | 5 750 000.00 | 5 823 623.00 | 1.57 |
| USD | ICICI BANK LTD/DUBAI-REG-S 4.00000% 16-18.03.26 | 3 600 000.00 | 3 718 224.00 | 1.00 |
| USD | NTPC LTD-REG-S 4.37500% 14-26.11.24 | 2 450 000.00 | 2 653 374.50 | 0.71 |
| USD | NWD MTN LTD-REG-S 4.37500% 15-30.11.22 | 3 500 000.00 | 3 698 492.00 | 1.00 |
| USD | NWD MTN LTD-REG-S 5.25000% 14-26.02.21 | 2 000 000.00 | 2 178 554.00 | 0.59 |
| USD | OTTAWA HOLDINGS PTE LTD-REG-S 5.87500% 13-16.05.18 | 1 500 000.00 | 1 029 660.00 | 0.28 |
| USD | SAN MIGUEL CORP-REG-S 4.87500% 13-26.04.23 | 4 150 000.00 | 4 254 746.00 | 1.15 |
| USD | SHINHAN BANK-REG-S-SUB 3.87500% 16-24.03.26 | 1 400 000.00 | 1 484 168.00 | 0.40 |
| USD | TEMASEK FINANCIAL I LTD-REG-S 3.37500% 12-23.07.42 | 1 850 000.00 | 2 019 645.00 | 0.54 |
| USD | TENCENT HOLDINDS LTD-REG-S 2.87500% 15-11.02.20 | 2 600 000.00 | 2 667 314.00 | 0.72 |
| **Total USD** | | | **47 661 823.65** | **12.84** |

| | | |
|---|---|---|
| **Total Medium-Term Notes, fester zins** | **47 661 823.65** | **12.84** |

### Medium-Term Notes, variabler zins

**USD**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| USD | DBS GROUP HOLDINGS LTD-REG-S-SUB 3.600%/VAR 16-PRP | 3 200 000.00 | 3 184 566.40 | 0.86 |
| USD | MALAYAN BANKING-REG-S-SUB 3.250%/H15T5Y+260BP 12-20.09.22 | 3 750 000.00 | 3 795 337.50 | 1.02 |
| USD | OVERSEA-CHINESE BKNG CORP-REG-S-SUB 3.150%/VAR 12-11.03.23 | 3 950 000.00 | 4 017 347.50 | 1.08 |
| USD | OVERSEA-CHINESE BKNG-SUB 3.750%/3M LIBOR+184.8BP 10-15.11.22 | 4 100 000.00 | 4 185 731.00 | 1.13 |
| USD | UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 2.875%/VAR 12-17.10.22 | 2 860 000.00 | 2 889 629.60 | 0.78 |
| USD | WING HANG BANK LTD-SUB 6.00000%/3M LIBOR+185BP 07-PRP | 5 450 000.00 | 5 545 266.00 | 1.49 |
| **Total USD** | | | **23 617 878.00** | **6.36** |

| | | |
|---|---|---|
| **Total Medium-Term Notes, variabler zins** | **23 617 878.00** | **6.36** |

### Anleihen, fester zins

**USD**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| USD | BLUESTAR FINANCE HOLDINGS LTD-REG-S 3.50000% 16-30.09.21 | 7 050 000.00 | 7 054 180.65 | 1.90 |
| USD | CHINA AOYUAN PROPERTY GROUP LTD-REG-S 11.25000% 14-17.01.19 | 750 000.00 | 804 780.00 | 0.22 |
| USD | CHINA AOYUAN PROPERTY GROUP LTD-REG-S 6.52500% 16-25.04.19 | 1 950 000.00 | 2 019 895.80 | 0.54 |
| USD | CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN III-REG-S 6.37500% 13-29.10.43 | 1 800 000.00 | 2 327 832.00 | 0.63 |
| USD | COMMONWEALTH BK OF AUSTRALIA-REG-S-SUB 4.50000% 15-09.12.25 | 3 000 000.00 | 3 212 910.00 | 0.87 |
| USD | COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 7.50000% 15-09.03.20 | 1 700 000.00 | 1 823 017.09 | 0.49 |
| USD | FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD-REG-S 11.50000% 15-01.06.18 | 1 250 000.00 | 1 353 348.75 | 0.36 |
| USD | FIRST GEN CORP-REG-S 6.50000% 13-09.10.23 | 740 000.00 | 804 306.00 | 0.22 |

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in USD NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|
| USD | FUTURE LAND DEV HLDGS LTD-REG-S 10.25000% 14-21.07.19 | 300 000.00 | 327 576.00 | 0.09 |
| USD | GREENKO INVESTMENT CO-REG-S 4.87500% 16-16.08.23 | 2 400 000.00 | 2 347 874.40 | 0.63 |
| USD | KOREA DEVELOPMENT BANK 2.25000% 15-18.05.20 | 7 950 000.00 | 8 107 728.00 | 2.18 |
| USD | LONGFOR PROPERTIES-REG-S 6.75000% 13-29.01.23 | 500 000.00 | 537 589.80 | 0.14 |
| USD | MINERA Y METALURGICA DEL BOLEO-REG-S 2.87500% 14-07.05.19 | 4 650 000.00 | 4 756 554.75 | 1.28 |
| USD | PROVEN HONOUR CAPITAL LTD-REG-S 4.12500% 15-19.05.25 | 7 200 000.00 | 7 660 008.00 | 2.06 |
| USD | QATAR, STATE OF-REG-S 4.62500% 16-02.06.46 | 2 000 000.00 | 2 180 000.00 | 0.59 |
| USD | SHENHUA OVERSEAS CAPITAL CO LTD-REG-S 3.87500% 15-20.01.25 | 2 000 000.00 | 2 133 720.00 | 0.57 |
| USD | SMALL & MEDIUM BUSINESS CORP-REG-S 2.12500% 16-30.08.26 | 4 900 000.00 | 4 858 531.30 | 1.31 |
| USD | SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.85000% 15-03.11.25 | 2 000 000.00 | 2 148 940.00 | 0.58 |
| USD | SRILANKAN AIRLINES LTD-REG-S 5.30000% 14-27.06.19 | 2 600 000.00 | 2 596 854.00 | 0.70 |
| USD | THETA CAPITAL PTE LTD-REG-S 7.00000% 14-11.04.22 | 1 650 000.00 | 1 741 754.85 | 0.47 |
| USD | VIETNAM, SOCIALIST REPUBLIC-REG-S 4.80000% 14-19.11.24 | 1 000 000.00 | 1 061 508.00 | 0.29 |
| USD | WEST CHINA CEMENT LTD-REG-S 6.50000% 14-11.09.19 | 2 500 000.00 | 2 591 850.00 | 0.70 |
| USD | WESTPAC BANKING CORP-REG-S 2.10000% 16-25.02.21 | 4 200 000.00 | 4 264 596.00 | 1.15 |
| USD | YUZHOU PROPERTIES CO LTD-REG-S 9.00000% 14-08.12.19 | 1 000 000.00 | 1 094 490.00 | 0.30 |
| **Total USD** | | | **67 809 845.39** | **18.27** |
| **Total Anleihen, fester zins** | | | **67 809 845.39** | **18.27** |
| **Anleihen, variabler zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | CHINA CONSTRUCTION BANK-REG-S-SUB 3.875%/VAR 15-13.05.25 | 5 700 000.00 | 5 878 421.40 | 1.58 |
| USD | CHINA LIFE INSURANCE CO LTD-REG-S-SUB 4.000%/VAR 15-03.07.75 | 1 750 000.00 | 1 764 308.00 | 0.48 |
| USD | CLP POWER HK FINANCE LTD-REG-S-SUB 4.250%/VAR 14-PRP | 1 450 000.00 | 1 507 202.50 | 0.41 |
| USD | KOREAN AIR LINES CO LTD-REG-S 2.500%/VAR 15-25.11.45 | 8 150 000.00 | 8 220 130.75 | 2.21 |
| USD | PETRON CORP-REG-S-SUB 7.500%/VAR 13-PRP | 3 000 000.00 | 3 192 780.00 | 0.86 |
| USD | ROYAL CAPITAL BV 5.500%/VAR 15-PRP | 4 500 000.00 | 4 685 760.00 | 1.26 |
| USD | SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP-REG-S-SUB 6.750%/VAR 15-PRP | 3 350 000.00 | 3 555 981.45 | 0.96 |
| USD | SUN HUNG KAI PROPERTIES-REG-S 3.375/VAR 14-25.02.24 | 4 700 000.00 | 4 823 675.80 | 1.30 |
| **Total USD** | | | **33 628 259.90** | **9.06** |
| **Total Anleihen, variabler zins** | | | **33 628 259.90** | **9.06** |
| **Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden** | | | **283 862 117.73** | **76.48** |

## Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Notes, fester zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | ALIBABA GROUP HOLDING LTD 3.60000% 15-28.11.24 | 4 000 000.00 | 4 189 132.00 | 1.13 |
| USD | NEXEN INC 5.87500% 05-10.03.35 | 9 350 000.00 | 11 567 876.10 | 3.12 |
| **Total USD** | | | **15 757 008.10** | **4.25** |
| **Total Notes, fester zins** | | | **15 757 008.10** | **4.25** |
| **Medium-Term Notes, fester zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CN/NY 2.35100% 14-13.11.17 | 4 850 000.00 | 4 881 622.00 | 1.31 |
| **Total USD** | | | **4 881 622.00** | **1.31** |
| **Total Medium-Term Notes, fester zins** | | | **4 881 622.00** | **1.31** |
| **Anleihen, fester zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | CNOOC FINANCE 2013 LTD 3.00000% 13-09.05.23 | 9 650 000.00 | 9 769 949.50 | 2.63 |
| USD | LODHA DEVELOPERS INTL LTD-REG-S 12.00000% 15-13.03.20 | 500 000.00 | 485 455.00 | 0.13 |
| USD | SSG RESOURCES LTD -REG-S 4.25000% 12-04.10.22 | 5 339 000.00 | 5 721 496.64 | 1.54 |
| **Total USD** | | | **15 976 901.14** | **4.30** |
| **Total Anleihen, fester zins** | | | **15 976 901.14** | **4.30** |
| **Anleihen, variabler zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | ICICI BANK LTD-REG-S-SUB 6.375%/6M LIBOR+228BP 07-30.04.22 | 4 900 000.00 | 4 993 232.30 | 1.35 |
| **Total USD** | | | **4 993 232.30** | **1.35** |
| **Total Anleihen, variabler zins** | | | **4 993 232.30** | **1.35** |
| **Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | **41 608 763.54** | **11.21** |

## OGAW/Andere OGA im Sinne des Artikels 41 (1) e) des abgeänderten luxemburgischen Gesetzes vom 17. Dezember 2010

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Investment Fonds, open end** | | | | |
| **Luxemburg** | | | | |
| USD | UBS (LUX) BOND SICAV-ASIAN INVST GRADE BONDS (USD)-U-X-CAP | 1 500.00 | 15 601 005.00 | 4.20 |
| **Total Luxemburg** | | | **15 601 005.00** | **4.20** |
| **Total Investment Fonds, open end** | | | **15 601 005.00** | **4.20** |
| **Total OGAW/Andere OGA im Sinne des Artikels 41 (1) e) des abgeänderten luxemburgischen Gesetzes vom 17. Dezember 2010** | | | **15 601 005.00** | **4.20** |

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in USD NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|

### Derivative Instrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden

**Optionen auf Anleihe-Futures, klassisch**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **USD** | | | | |
| USD | US 10YR TREASURY NOTE FUTURE PUT 129.00000 DEC16 25.11.16 | -224.00 | -52 500.00 | -0.01 |
| USD | US 10YR TREASURY NOTE FUTURE CALL 131.50000 DEC16 25.11.16 | 224.00 | 161 000.00 | 0.04 |
| USD | US 10YR TREASURY NOTE FUTURE CALL 132.50000 DEC16 25.11.16 | -224.00 | -87 500.00 | -0.02 |
| **Total USD** | | | **21 000.00** | **0.01** |
| **Total Optionen auf Anleihe-Futures, klassisch** | | | **21 000.00** | **0.01** |
| **Total Derivative Instrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden** | | | **21 000.00** | **0.01** |
| **Total des Wertpapierbestandes** | | | **341 092 886.27** | **91.90** |

## Derivative Instrumente

### Derivative Instrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden

**Financial Futures auf Anleihen**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| USD | US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 20.12.16 | 54.00 | -133 312.50 | -0.04 |
| **Total Financial Futures auf Anleihen** | | | **-133 312.50** | **-0.04** |
| **Total Derivative Instrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden** | | | **-133 312.50** | **-0.04** |
| **Total Derivative Instrumente** | | | **-133 312.50** | **-0.04** |

### Devisenterminkontrakte

**Devisenterminkontrakte (Kauf/Verkauf)**

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| EUR | 62 511 500.00 | USD | 70 593 549.32 | 17.10.2016 | -298 814.97 | -0.08 |
| SGD | 29 900 300.00 | USD | 22 214 454.26 | 17.10.2016 | -282 196.11 | -0.07 |
| USD | 2 904 021.19 | EUR | 2 581 600.00 | 17.10.2016 | 989.17 | 0.00 |
| USD | 2 031 508.03 | SGD | 2 780 200.00 | 17.10.2016 | -7 804.76 | 0.00 |
| USD | 7 984 859.05 | SGD | 10 865 900.00 | 17.10.2016 | 14 580.36 | 0.00 |
| USD | 642 634.13 | EUR | 576 200.00 | 17.10.2016 | -5 307.86 | 0.00 |
| USD | 164 306.00 | SGD | 222 400.00 | 17.10.2016 | 1 172.71 | 0.00 |
| JPY | 1 485 402 000.00 | USD | 14 800 000.00 | 4.1.2017 | -66 292.82 | -0.02 |
| USD | 14 800 000.00 | TWD | 461 094 000.00 | 4.1.2017 | -27 611.85 | -0.01 |
| **Total Devisenterminkontrakte (Kauf/Verkauf)** | | | | | **-671 286.13** | **-0.18** |

| | | |
|---|---|---|
| **Bankguthaben, Sicht- und Fristgelder und andere liquide Mittel** | **23 951 259.40** | **6.45** |
| **Andere Aktiva und Passiva** | **6 924 245.96** | **1.87** |
| **Total des Nettovermögens** | **371 163 793.00** | **100.00** |

# UBS (Lux) Bond Fund – GBP

## Wichtigste Daten

| | ISIN | 30.9.2016 | 31.3.2016 | 31.3.2015 |
|---|---|---|---|---|
| Nettovermögen in GBP | | 47 168 853.42 | 48 822 453.11 | 62 684 140.77 |
| **Klasse F-acc** | **LU0415169761** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 17 233.0000 | 19 823.1410 | 17 261.6510 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in GBP | | 251.26 | 228.28 | 227.18 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in GBP[1] | | 251.26 | 228.28 | 227.18 |
| **Klasse P-acc** | **LU0035346187** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 121 665.9030 | 137 300.9040 | 189 272.3570 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in GBP | | 246.67 | 224.80 | 225.06 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in GBP[1] | | 246.67 | 224.80 | 225.06 |
| **Klasse P-dist** | **LU0035345882** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 146 042.5110 | 167 698.0690 | 232 822.7730 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in GBP | | 71.09 | 67.02 | 69.43 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in GBP[1] | | 71.09 | 67.02 | 69.43 |
| **Klasse Q-acc[2]** | **LU0415169928** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 7 488.3860 | 8 202.0940 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in GBP | | 113.65 | 103.37 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in GBP[1] | | 113.65 | 103.37 | - |
| **Klasse Q-dist[2]** | **LU0415169845** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 14 221.1290 | 13 019.3670 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in GBP | | 112.15 | 103.38 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in GBP[1] | | 112.15 | 103.38 | - |

[1] Siehe Erläuterung 1
[2] Erste NAV 19.11.2015

## Struktur des Wertpapierbestandes

| Geographische Aufteilung in % des Nettovermögens | |
|---|---|
| Grossbritannien | 39.76 |
| Frankreich | 11.43 |
| Vereinigte Staaten | 9.79 |
| Supranational | 8.43 |
| Niederlande | 8.15 |
| Australien | 4.50 |
| Deutschland | 2.44 |
| Belgien | 2.38 |
| Jersey | 2.33 |
| Cayman-Inseln | 2.11 |
| Schweden | 1.39 |
| Spanien | 1.18 |
| Norwegen | 1.00 |
| Singapur | 0.77 |
| Schweiz | 0.69 |
| Irland | 0.55 |
| Mexiko | 0.52 |
| Japan | 0.45 |
| **Total** | **97.87** |

| Wirtschaftliche Aufteilung in % des Nettovermögens | |
|---|---|
| Banken & Kreditinstitute | 29.06 |
| Finanz- & Beteiligungsgesellschaften | 14.20 |
| Energie- & Wasserversorgung | 8.75 |
| Supranationale Organisationen | 8.43 |
| Pfandbriefinstitute & Refinanzierungsgesellschaften | 6.60 |
| Öffentlich-rechtliche Körperschaften | 4.82 |
| Diverse nicht klassierte Gesellschaften | 3.07 |
| Verkehr & Transport | 3.07 |
| Pharmazeutik, Kosmetik & medizinische Produkte | 3.06 |
| Telekommunikation | 2.65 |
| Versicherungen | 2.64 |
| Detailhandel, Warenhäuser | 2.21 |
| Immobilien | 1.83 |
| Länder- & Zentralregierungen | 1.70 |
| Diverse Dienstleistungen | 1.15 |
| Erdöl | 1.00 |
| Elektrische Geräte & Komponenten | 0.84 |
| Tabak & alkoholische Getränke | 0.68 |
| Fahrzeuge | 0.66 |
| Anlagefonds | 0.59 |
| Elektronik & Halbleiter | 0.30 |
| Grafisches Gewerbe, Verlage & Medien | 0.30 |
| Computer & Netzwerkausrüster | 0.26 |
| **Total** | **97.87** |

## Nettovermögensaufstellung

| | | GBP |
|---|---|---|
| **Aktiva** | | **30.9.2016** |
| Wertpapierbestand, Einstandswert | 41 023 134.92 | |
| Wertpapierbestand, nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) | 5 140 379.64 | |
| Total Wertpapierbestand (Erläuterung 1) | | 46 163 514.56 |
| Bankguthaben, Sicht- und Fristgelder | | 551 881.50 |
| Andere liquide Mittel (Margins) | | 17 658.00 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen (Erläuterung 1) | | 561 002.25 |
| Zinsforderungen aus Wertpapieren | | 883 634.99 |
| Zinsforderungen aus liquiden Mitteln | | 58.07 |
| Nicht realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten (Erläuterung 1) | | 642.00 |
| **Total Aktiva** | | **48 178 391.37** |
| | | |
| **Passiva** | | |
| Verbindlichkeiten aus Rücknahmen | | -986 859.88 |
| Rückstellungen für pauschale Verwaltungskommission (Erläuterung 2) | -16 551.41 | |
| Rückstellungen für Abonnementsabgabe (Erläuterung 3) | -5 463.11 | |
| Rückstellungen für sonstige Kommissionen und Gebühren (Erläuterung 2) | -663.55 | |
| Total Rückstellungen für Aufwendungen | | -22 678.07 |
| **Total Passiva** | | **-1 009 537.95** |
| | | |
| **Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode** | | **47 168 853.42** |

## Ertrags- und Aufwandsrechnung

| | GBP |
|---|---|
| **Erträge** | **1.4.2016-30.9.2016** |
| Zinsertrag auf liquide Mittel | 397.58 |
| Zinsen auf Wertpapiere | 969 049.46 |
| Erträge aus Securities Lending (Erläuterung 11) | 9 088.62 |
| Sonstige Erträge | 22 391.67 |
| **Total Erträge** | **1 000 927.33** |
| | |
| **Aufwendungen** | |
| Kosten aus Securities Lending (Erläuterung 11) | -3 635.45 |
| Pauschale Verwaltungskommission (Erläuterung 2) | -200 130.91 |
| Abonnementsabgabe (Erläuterung 3) | -11 087.12 |
| Sonstige Kommissionen und Gebühren (Erläuterung 2) | -3 205.09 |
| **Total Aufwendungen** | **-218 058.57** |
| | |
| **Nettoerträge (-verluste) aus Anlagen** | **782 868.76** |
| | |
| **Realisierte Gewinne (Verluste) (Erläuterung 1)** | |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus marktbewerteten Wertpapieren ausser Optionen | 585 319.70 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten | -1 575.00 |
| Realisierter Währungsgewinn (-verlust) | 192.26 |
| **Total der realisierten Gewinne (Verluste)** | **583 936.96** |
| | |
| **Realisierter Nettogewinn (-verlust) der Berichtsperiode** | **1 366 805.72** |
| | |
| **Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung) (Erläuterung 1)** | |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) marktbewerteter Wertpapiere ausser Optionen | 2 969 367.14 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) von Finanzterminkontrakten | 1 742.00 |
| **Total der Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung)** | **2 971 109.14** |
| | |
| **Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens infolge Geschäftstätigkeit** | **4 337 914.86** |

## Veränderungen des Nettovermögens

| | GBP |
|---|---|
| | **1.4.2016-30.9.2016** |
| Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode | 48 822 453.11 |
| Zeichnungen | 5 941 559.45 |
| Rücknahmen | -11 539 826.52 |
| Total Mittelzufluss (-abfluss) | -5 598 267.07 |
| Ausbezahlte Dividende | -393 247.48 |
| Nettoerträge (-verluste) aus Anlagen | 782 868.76 |
| Total der realisierten Gewinne (Verluste) | 583 936.96 |
| Total der Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung) | 2 971 109.14 |
| Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens infolge Geschäftstätigkeit | 4 337 914.86 |
| **Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode** | **47 168 853.42** |

## Entwicklung der Anteile im Umlauf

| | **1.4.2016-30.9.2016** |
|---|---|
| **Klasse** | **F-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 19 823.1410 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 8 030.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -10 620.1410 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **17 233.0000** |
| **Klasse** | **P-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 137 300.9040 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 13 391.0680 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -29 026.0690 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **121 665.9030** |
| **Klasse** | **P-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 167 698.0690 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 3 722.3260 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -25 377.8840 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **146 042.5110** |
| **Klasse** | **Q-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 8 202.0940 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 2 291.7790 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -3 005.4870 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **7 488.3860** |
| **Klasse** | **Q-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 13 019.3670 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 2 498.3780 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -1 296.6160 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **14 221.1290** |

## Jährliche Ausschüttung

| UBS (Lux) Bond Fund | Ex-Date | Pay-Date | Währung | Betrag pro Anteil |
|---|---|---|---|---|
| – GBP P-dist | 1.6.2016 | 6.6.2016 | GBP | 2.28 |
| – GBP Q-dist | 1.6.2016 | 6.6.2016 | GBP | 1.40 |

# Aufstellung der Wertpapierbestände und anderer Nettovermögenswerte per 30. September 2016

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in GBP NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|

## Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden

### Asset Backed Securities, fester Zins

**GBP**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| GBP | BL SUPERSTORES FINANCE PLC 4.48200% 06-04.10.25 | 550 000.00 | 505 933.63 | 1.07 |
| **Total GBP** | | | **505 933.63** | **1.07** |
| **Total Asset Backed Securities, fester Zins** | | | **505 933.63** | **1.07** |

### Mortgage Backed Securities, fester Zins

**GBP**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| GBP | MEADOWHALL FINANCE PLC 4.98600% 06-12.01.32 | 245 000.00 | 255 418.89 | 0.54 |
| **Total GBP** | | | **255 418.89** | **0.54** |
| **Total Mortgage Backed Securities, fester Zins** | | | **255 418.89** | **0.54** |

### Notes, fester Zins

**GBP**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| GBP | AMERICA MOVIL SAB DE CV 4.37500% 12-07.08.41 | 200 000.00 | 243 352.00 | 0.51 |
| GBP | APPLE INC 3.60000% 15-31.07.42 | 100 000.00 | 121 548.00 | 0.26 |
| GBP | BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC 5.75000% 99-07.12.28 | 50 000.00 | 70 753.00 | 0.15 |
| GBP | BROADGATE FINANCING PLC 4.82100% 05-05.07.33 | 500 000.00 | 683 566.50 | 1.45 |
| GBP | EUROPEAN INVESTMENT BANK 5.62500% 00-07.06.32 | 150 000.00 | 238 875.00 | 0.51 |
| GBP | EUROPEAN INVESTMENT BANK 4.62500% 04-12.10.54 | 100 000.00 | 183 518.00 | 0.39 |
| GBP | LONDON & QUADRANT HOUSING TRUST 5.50000% 10-27.01.40 | 250 000.00 | 382 790.00 | 0.81 |
| GBP | SEGRO PLC 6.75000% 00-23.02.24 | 250 000.00 | 335 825.00 | 0.71 |
| GBP | STANDARD CHARTERED BANK PLC-SUB 7.75000% 08-03.04.18 | 500 000.00 | 545 240.00 | 1.16 |
| GBP | UNITE USAF II PLC 3.37400% 13-30.06.23 | 250 000.00 | 276 617.50 | 0.59 |
| GBP | WESSEX WATER SERVICES FINANCE LTD 5.37500% 05-10.03.28 | 150 000.00 | 204 667.50 | 0.43 |
| **Total GBP** | | | **3 286 752.50** | **6.97** |
| **Total Notes, fester Zins** | | | **3 286 752.50** | **6.97** |

### Medium-Term Notes, fester Zins

**GBP**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| GBP | ABN AMRO BANK NV 4.87500% 12-16.01.19 | 300 000.00 | 327 717.00 | 0.69 |
| GBP | AEGON NV 6.12500% 99-15.12.31 | 200 000.00 | 295 852.00 | 0.63 |
| GBP | AFFINITY SUTTON CM PLC 5.98100% 08-17.09.38 | 200 000.00 | 313 790.00 | 0.66 |
| GBP | ANGLIAN WATER SERVICES FINANCING PLC 4.50000% 12-05.10.27 | 300 000.00 | 383 238.00 | 0.81 |
| GBP | BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV 5.20000% 99-07.12.28 | 500 000.00 | 700 470.00 | 1.48 |
| GBP | BANK OF AMERICA CORP 7.75000% 08-30.04.18 | 400 000.00 | 440 664.00 | 0.93 |
| GBP | BARCLAYS BANK PLC 5.75000% 09-17.08.21 | 150 000.00 | 183 235.50 | 0.39 |
| GBP | BARCLAYS BANK PLC-REG-S 4.25000% 12-12.01.22 | 200 000.00 | 234 652.00 | 0.50 |
| GBP | BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC 6.00000% 09-24.11.34 | 200 000.00 | 308 404.00 | 0.65 |
| GBP | BELGIUM, KINGDOM OF 5.00000% 03-24.04.18 | 270 000.00 | 288 192.60 | 0.61 |
| GBP | BHP BILLITON FINANCE LTD 3.25000% 12-25.09.24 | 200 000.00 | 223 802.00 | 0.47 |
| GBP | BHP BILLITON FINANCE LTD 4.30000% 12-25.09.42 | 300 000.00 | 383 541.00 | 0.81 |
| GBP | BMW FINANCE NV 5.00000% 09-02.10.17 | 300 000.00 | 312 570.00 | 0.66 |
| GBP | CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SOCIALE 3.75000% 11-15.10.18 | 200 000.00 | 212 924.00 | 0.45 |
| GBP | CENTRICA PLC 7.00000% 08-19.09.33 | 100 000.00 | 165 000.00 | 0.35 |
| GBP | CENTRICA PLC-REG-S 6.37500% 09-10.03.22 | 100 000.00 | 127 498.00 | 0.27 |
| GBP | CITIGROUP INC 5.15000% 03-21.05.26 | 200 000.00 | 249 944.00 | 0.53 |
| GBP | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 3.00000% 12-04.09.26 | 400 000.00 | 461 188.00 | 0.98 |
| GBP | COMMUNITY FINANCE CO 1 PLC 5.01700% 11-31.07.34 | 100 000.00 | 142 625.00 | 0.30 |
| GBP | COVENTRY BUILDING SOCIETY 6.00000% 09-16.10.19 | 400 000.00 | 457 100.00 | 0.97 |
| GBP | EAST JAPAN RAILWAY CO 4.87500% 06-14.06.34 | 150 000.00 | 210 130.50 | 0.45 |
| GBP | ELECTRICITE DE FRANCE 6.12500% 09-02.06.34 | 300 000.00 | 436 464.00 | 0.93 |
| GBP | ELECTRICITE DE FRANCE 5.50000% 11-17.10.41 | 300 000.00 | 425 673.00 | 0.90 |
| GBP | ELECTRICITE DE FRANCE 6.87500% 08-12.12.22 | 300 000.00 | 400 362.00 | 0.85 |
| GBP | ENGIE SA 6.12500% 09-11.02.21 | 400 000.00 | 490 120.00 | 1.04 |
| GBP | ENGIE SA-REG-S 5.00000% 10-01.10.60 | 250 000.00 | 436 690.00 | 0.93 |
| GBP | EUROPEAN INVESTMENT BANK 5.00000% 99-15.04.39 | 250 000.00 | 407 250.00 | 0.86 |
| GBP | EUROPEAN INVESTMENT BANK 5.37500% 07-07.03.19 | 800 000.00 | 895 000.00 | 1.90 |
| GBP | EUROPEAN INVESTMENT BANK 4.50000% 09-07.06.29 | 700 000.00 | 959 196.00 | 2.03 |
| GBP | EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.87500% 12-08.06.37 | 250 000.00 | 350 437.50 | 0.74 |
| GBP | EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.50000% 13-01.02.19 | 400 000.00 | 410 608.00 | 0.87 |
| GBP | EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 2.25000% 14-07.03.20 | 500 000.00 | 530 630.00 | 1.12 |
| GBP | GATWICK FUNDING LTD 5.75000% 12-23.01.37 | 200 000.00 | 305 302.00 | 0.65 |
| GBP | GENERAL ELECTRIC CO 5.50000% 98-07.06.21 | 300 000.00 | 362 454.00 | 0.77 |
| GBP | GENERAL ELECTRIC CO 6.44000% 00-15.11.22 | 1 000 000.00 | 235 742.72 | 0.50 |
| GBP | HEATHROW FUNDING LTD 5.87500% 11-13.05.41 | 500 000.00 | 793 755.00 | 1.68 |
| GBP | HSBC HOLDINGS PLC 6.50000% 09-20.05.24 | 300 000.00 | 386 133.00 | 0.82 |
| GBP | HSBC HOLDINGS PLC-SUB 7.00000% 08-07.04.38 | 350 000.00 | 497 889.00 | 1.06 |
| GBP | ING BANK NV 5.37500% 11-15.04.21 | 300 000.00 | 357 354.00 | 0.76 |
| GBP | JPMORGAN CHASE BANK NA 3.50000% 12-18.12.26 | 200 000.00 | 225 850.00 | 0.48 |
| GBP | KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 6.00000% 00-07.12.28 | 50 000.00 | 77 785.00 | 0.16 |
| GBP | KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 4.87500% 04-15.03.37 | 420 000.00 | 672 306.60 | 1.43 |
| GBP | LLOYDS BANK PLC 6.50000% 10-17.09.40 | 200 000.00 | 329 592.00 | 0.70 |
| GBP | LLOYDS BANK PLC 7.50000% 09-15.04.24 | 200 000.00 | 281 390.00 | 0.60 |
| GBP | METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 3.50000% 12-30.09.26 | 500 000.00 | 565 015.00 | 1.20 |
| GBP | MOTABILITY OPERATIONS GROUP PLC 6.62500% 09-10.12.19 | 400 000.00 | 473 900.00 | 1.00 |
| GBP | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 5.12500% 09-09.12.21 | 250 000.00 | 298 312.50 | 0.63 |
| GBP | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 3.00000% 12-04.09.26 | 400 000.00 | 461 796.00 | 0.98 |
| GBP | NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 5.62500% 11-28.01.26 | 200 000.00 | 276 198.00 | 0.59 |
| GBP | NATIXIS 5.87500% 00-24.02.20 | 700 000.00 | 810 075.00 | 1.72 |
| GBP | NETWORK RAIL INFRASTRUCTURE FINANCE PLC 4.37500% 05-09.12.30 | 200 000.00 | 276 510.00 | 0.59 |
| GBP | NRAM LTD 6.37500% 99-02.12.19 | 300 000.00 | 346 002.00 | 0.73 |

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in GBP NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|
| GBP | RABOBANK NEDERLAND NV 4.62500% 11-13.01.21 | 700 000.00 | 800 702.00 | 1.70 |
| GBP | RABOBANK NEDERLAND NV 5.25000% 11-23.05.41 | 200 000.00 | 291 970.00 | 0.62 |
| GBP | ROYAL BANK OF SCOTLAND PLC 6.62500% 08-17.09.18 | 200 000.00 | 220 636.00 | 0.47 |
| GBP | SANTANDER UK PLC-REG-S 5.75000% 11-02.03.26 | 400 000.00 | 552 444.00 | 1.17 |
| GBP | SANTANDER UK PLC-REG-S 5.25000% 12-16.02.29 | 150 000.00 | 210 444.00 | 0.45 |
| GBP | SCENTRE GROUP TRUST 1-REG-S 3.87500% 14-16.07.26 | 250 000.00 | 292 107.50 | 0.62 |
| GBP | SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ-REG-S 2.75000% 12-10.09.25 | 300 000.00 | 339 222.00 | 0.72 |
| GBP | SMITHKLINE BEECHAM CAPITAL PLC 5.25000% 01-19.12.33 | 400 000.00 | 595 372.00 | 1.26 |
| GBP | SMITHKLINE BEECHAM CAPITAL PLC 6.37500% 08-09.03.39 | 100 000.00 | 173 395.00 | 0.37 |
| GBP | SNCF RESEAU-REG-S 5.50000% 98-01.12.21 | 200 000.00 | 245 618.00 | 0.52 |
| GBP | SNCF RESEAU-REG-S 5.25000% 99-07.12.28 | 800 000.00 | 1 112 456.00 | 2.36 |
| GBP | SOUTHERN WATER SERVICES (FINANCE) LTD 6.19200% 03-31.03.29 | 200 000.00 | 295 060.00 | 0.63 |
| GBP | SOUTHERN WATER SERVICES (FINANCE) LTD 5.00000% 05-31.03.21 | 200 000.00 | 233 882.00 | 0.50 |
| GBP | STATOIL ASA 6.87500% 09-11.03.31 | 300 000.00 | 472 854.00 | 1.00 |
| GBP | SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S 4.00000% 12-18.01.19 | 300 000.00 | 321 696.00 | 0.68 |
| GBP | TELEFONICA EMISIONES SAU 5.44500% 10-08.10.29 | 100 000.00 | 134 310.00 | 0.28 |
| GBP | TELFONICA EMISIONES S.A. 5.37500% 06-02.02.18 | 400 000.00 | 423 100.00 | 0.90 |
| GBP | TEMASEK FINANCIAL I LTD 4.62500% 10-26.07.22 | 300 000.00 | 363 714.00 | 0.77 |
| GBP | THAMES WATER UTILITIES CAYMAN FINANCE 4.62500% 12-04.06.46 | 400 000.00 | 590 588.00 | 1.25 |
| GBP | THFC FUNDING NO 2 PLC 6.35000% 09-08.07.39 | 300 000.00 | 472 626.00 | 1.00 |
| GBP | TOTAL CAPITAL SA 4.25000% 09-08.12.17 | 500 000.00 | 520 540.00 | 1.10 |
| GBP | TRANSPORT FOR LONDON 3.87500% 12-23.07.42 | 350 000.00 | 478 996.00 | 1.02 |
| GBP | TRANSPORT FOR LONDON 2.25000% 12-09.08.22 | 700 000.00 | 758 898.00 | 1.61 |
| GBP | UBS AG LONDON 6.62500% 08-11.04.18 | 300 000.00 | 326 346.00 | 0.69 |
| GBP | VATTENFALL AB 6.87500% 09-15.04.39 | 200 000.00 | 335 706.00 | 0.71 |
| GBP | WELLS FARGO & CO-REG-S 2.00000% 16-28.07.25 | 300 000.00 | 300 756.00 | 0.64 |
| GBP | YORKSHIRE WATER SERVICES FINANCE PLC 6.37500% 09-19.08.39 | 100 000.00 | 169 219.00 | 0.36 |
| **Total GBP** | | | **31 230 987.42** | **66.21** |
| **Total Medium-Term Notes, fester Zins** | | | **31 230 987.42** | **66.21** |
| **Medium-Term Notes, variabler Zins** | | | | |
| **GBP** | | | | |
| GBP | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA 9.750%/RATING LINKED 09-30.07.24 | 200 000.00 | 321 342.00 | 0.68 |
| GBP | ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 6.000%/VAR 13-PRP | 300 000.00 | 300 843.00 | 0.64 |
| GBP | HEATHROW FUNDING-REG-S 5.250%/12M LIBOR+400BP 08-15.02.25 | 200 000.00 | 244 798.00 | 0.52 |
| GBP | HSBC HOLDINGS PLC-SUB 6.37500%/3M LIBOR+130BP 07-18.10.22 | 700 000.00 | 730 310.00 | 1.55 |
| **Total GBP** | | | **1 597 293.00** | **3.39** |
| **Total Medium-Term Notes, variabler Zins** | | | **1 597 293.00** | **3.39** |
| **Anleihen, fester Zins** | | | | |
| **GBP** | | | | |
| GBP | ALLIANZ FINANCE II BV 4.50000% 13-13.03.43 | 300 000.00 | 417 774.00 | 0.89 |
| GBP | BELGIUM, KINGDOM OF-REG-S 9.37500% 95-21.02.20 | 400 000.00 | 514 588.00 | 1.09 |
| GBP | BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC 8.62500% 94-26.03.20 | 300 000.00 | 379 173.00 | 0.80 |
| GBP | CANARY WHARF FINANCE II PLC 6.45500% 00-22.10.33 | 400 000.00 | 158 010.62 | 0.33 |
| GBP | CIRCLE ANGLIA SOCIAL HOUSING PLC 7.25000% 08-12.11.38 | 200 000.00 | 349 652.00 | 0.74 |
| GBP | COMCAST CORP 5.50000% 10-23.11.29 | 100 000.00 | 141 192.00 | 0.30 |
| GBP | EAST FINANCE PLC 5.48600% 12-15.06.42 | 100 000.00 | 147 370.00 | 0.31 |
| GBP | EMH TREASURY PLC 4.50000% 14-29.01.44 | 100 000.00 | 129 724.00 | 0.28 |
| GBP | FMS WERTMANAGEMENT-REG-S 1.00000% 15-10.04.18 | 400 000.00 | 403 388.00 | 0.86 |
| GBP | FRESHWATER FINANCE PLC 4.55600% 06-03.04.36 | 200 000.00 | 259 548.00 | 0.55 |
| GBP | GENFINANCE II PLC 6.06400% 09-21.12.39 | 100 000.00 | 150 116.00 | 0.32 |
| GBP | HSBC HOLDINGS PLC-SUB 6.75000% 08-11.09.28 | 200 000.00 | 254 018.00 | 0.54 |
| GBP | HUTCHISON WHAMPOA FINANCE LTD 5.62500% 06-24.11.26 | 150 000.00 | 201 597.00 | 0.43 |
| GBP | LCR FINANCE PLC-REG-S 4.50000% 99-07.12.38 | 250 000.00 | 375 312.50 | 0.80 |
| GBP | LLOYDS BANK PLC 6.00000% 11-08.02.29 | 600 000.00 | 890 226.00 | 1.89 |
| GBP | NATIONAL GRID CO PLC 5.87500% 99-02.02.24 | 300 000.00 | 397 950.00 | 0.84 |
| GBP | NOTTING HILL HOUSING TRUST-REG-S 3.75000% 12-20.12.32 | 200 000.00 | 232 848.00 | 0.49 |
| GBP | PFIZER INC 6.50000% 09-03.06.38 | 400 000.00 | 674 404.00 | 1.43 |
| GBP | PRUDENTIAL CORP PLC 6.87500% 98-20.01.23 | 400 000.00 | 529 584.00 | 1.12 |
| GBP | ROYAL BANK OF SCOTLAND PLC-REG-S 5.12500% 12-13.01.24 | 300 000.00 | 382 494.00 | 0.81 |
| GBP | SOUTHERN ELECTRIC POWER DISTRIBUTION 5.50000% 01-07.06.32 | 100 000.00 | 143 679.00 | 0.30 |
| GBP | SOUTHERN WATER SERVICES (FINANCE) LTD 4.50000% 06-31.03.52 | 100 000.00 | 148 484.00 | 0.31 |
| GBP | WAL-MART STORES INC 5.25000% 04-28.09.35 | 300 000.00 | 451 785.00 | 0.96 |
| GBP | WAL-MART STORES INC 4.87500% 06-19.01.39 | 400 000.00 | 588 824.00 | 1.25 |
| GBP | WELLCOME TRUST FINANCE PLC 4.62500% 06-25.07.36 | 200 000.00 | 298 870.00 | 0.63 |
| GBP | WHEATLEY GROUP CAPITAL PLC-REG-S 4.37500% 14-28.11.44 | 150 000.00 | 192 190.50 | 0.41 |
| GBP | YORKSHIRE ELECTRICITY DISTRIBUTION PLC 5.12500% 05-04.05.35 | 150 000.00 | 215 125.50 | 0.46 |
| **Total GBP** | | | **9 027 927.12** | **19.14** |
| **Total Anleihen, fester Zins** | | | **9 027 927.12** | **19.14** |
| **Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden** | | | **45 904 312.56** | **97.32** |

## Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Anleihen, fester Zins** | | | | |
| **GBP** | | | | |
| GBP | WELLS FARGO & CO 4.62500% 06-03.11.35 | 200 000.00 | 259 202.00 | 0.55 |
| **Total GBP** | | | **259 202.00** | **0.55** |
| **Total Anleihen, fester Zins** | | | **259 202.00** | **0.55** |
| **Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | **259 202.00** | **0.55** |
| **Total des Wertpapierbestandes** | | | **46 163 514.56** | **97.87** |

| Bezeichnung | | Anzahl/ Nominal | Bewertung in GBP NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|

## Derivative Instrumente

### Derivative Instrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Financial Futures auf Anleihen** | | | | |
| GBP | SHORT GILT FUTURE 28.12.16 | 30.00 | 642.00 | 0.00 |
| **Total Financial Futures auf Anleihen** | | | **642.00** | **0.00** |
| **Total Derivative Instrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden** | | | **642.00** | **0.00** |
| **Total Derivative Instrumente** | | | **642.00** | **0.00** |
| **Bankguthaben, Sicht- und Fristgelder und andere liquide Mittel** | | | **569 539.50** | **1.21** |
| **Andere Aktiva und Passiva** | | | **435 157.36** | **0.92** |
| **Total des Nettovermögens** | | | **47 168 853.42** | **100.00** |

# UBS (Lux) Bond Fund – Global (CHF)

## Wichtigste Daten

| | ISIN | 30.9.2016 | 31.3.2016 | 31.3.2015 |
|---|---|---|---|---|
| Nettovermögen in CHF | | 220 569 765.05 | 192 416 772.59 | 221 083 272.77 |
| **Klasse (CAD hedged) F-acc[1]** | **LU1467593940** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 57 380.1150 | - | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CAD | | 100.29 | - | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CAD[2] | | 100.29 | - | - |
| **Klasse I-B-acc[3]** | **LU0415185379** | | | |
| Anteile im Umlauf | | - | - | 169 452.7240 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | - | - | 122.98 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF[2] | | - | - | 122.98 |
| **Klasse P-acc** | **LU0071006638** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 58 682.1270 | 61 879.5110 | 72 357.4350 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 817.02 | 798.34 | 797.16 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF[2] | | 817.02 | 796.74 | 797.16 |
| **Klasse (CAD hedged) P-acc[1]** | **LU1467572357** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 1 037 224.1470 | - | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CAD | | 100.27 | - | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CAD[2] | | 100.27 | - | - |
| **Klasse (EUR hedged) P-acc** | **LU0487186396** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 109 114.6520 | 109 717.8000 | 66 479.1160 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 124.77 | 121.52 | 120.40 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[2] | | 124.77 | 121.28 | 120.40 |
| **Klasse (JPY hedged) P-acc** | **LU0817644254** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 87 895.2570 | 88 589.7640 | 89 563.9780 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in JPY | | 11 354.00 | 11 077.00 | 10 972.00 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in JPY[2] | | 11 354.00 | 11 055.00 | 10 972.00 |
| **Klasse P-dist** | **LU0071005408** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 73 591.6570 | 74 433.9390 | 92 024.9080 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 496.85 | 492.04 | 497.64 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF[2] | | 496.85 | 491.06 | 497.64 |
| **Klasse (CAD hedged) P-dist[1]** | **LU1467578123** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 274 126.7410 | - | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CAD | | 100.27 | - | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CAD[2] | | 100.27 | - | - |
| **Klasse (EUR hedged) P-dist** | **LU0487186123** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 15 851.1140 | 15 609.3570 | 21 967.9460 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in EUR | | 115.02 | 113.49 | 114.09 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in EUR[2] | | 115.02 | 113.26 | 114.09 |
| **Klasse (JPY hedged) P-dist[4]** | **LU0817644841** | | | |
| Anteile im Umlauf | | - | - | 2 905.3620 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in JPY | | - | - | 10 924.00 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in JPY[2] | | - | - | 10 924.00 |
| **Klasse Q-acc[5]** | **LU0415184216** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 6 997.8070 | 3 740.3860 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 104.93 | 102.26 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF[2] | | 104.93 | 102.06 | - |
| **Klasse (CAD hedged) Q-acc[1]** | **LU1467583982** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 73 095.2370 | - | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CAD | | 100.30 | - | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CAD[2] | | 100.30 | - | - |
| **Klasse Q-dist[5]** | **LU0415184133** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 13 942.9780 | 10 918.7480 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | 104.06 | 102.25 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF[2] | | 104.06 | 102.05 | - |
| **Klasse (CAD hedged) Q-dist[1]** | **LU1467589328** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 11 654.0990 | - | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CAD | | 100.29 | - | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CAD[2] | | 100.29 | - | - |
| **Klasse U-X-acc[6]** | **LU0415185700** | | | |
| Anteile im Umlauf | | - | 6 360.0000 | 6 247.0000 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF | | - | 12 586.24 | 12 420.10 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF[2] | | - | 12 561.07 | 12 420.10 |

[1] Erste NAV 23.9.2016
[2] Siehe Erläuterung 1
[3] Die Anteilsklasse I-B-acc war bis zum 5.5.2015 im Umlauf
[4] Die Anteilsklasse (JPY hedged) P-dist war bis zum 22.2.2016 im Umlauf
[5] Erste NAV 15.10.2015
[6] Die Anteilsklasse U-X-acc war bis zum 31.3.2016 im Umlauf

## Struktur des Wertpapierbestandes

| Geographische Aufteilung in % des Nettovermögens | |
|---|---|
| Vereinigte Staaten | 36.07 |
| Japan | 7.88 |
| Irland | 7.73 |
| Deutschland | 6.03 |
| Grossbritannien | 4.94 |
| Frankreich | 3.95 |
| Niederlande | 3.42 |
| Italien | 3.31 |
| Australien | 2.60 |
| Belgien | 2.29 |
| Supranational | 2.20 |
| Luxemburg | 1.71 |
| Neuseeland | 1.63 |
| Portugal | 1.51 |
| Österreich | 1.46 |
| Kanada | 0.82 |
| Spanien | 0.81 |
| Schweden | 0.75 |
| Norwegen | 0.58 |
| Jersey | 0.53 |
| Cayman-Inseln | 0.52 |
| Mexiko | 0.47 |
| Zypern | 0.47 |
| Britische Jungferninseln | 0.43 |
| Finnland | 0.41 |
| Türkei | 0.37 |
| Island | 0.36 |
| Malaysia | 0.30 |
| Brasilien | 0.26 |
| Indonesien | 0.23 |
| Südkorea | 0.22 |
| Hongkong | 0.22 |
| Bermuda | 0.22 |
| Kolumbien | 0.21 |
| Dänemark | 0.18 |
| Kasachstan | 0.14 |
| Peru | 0.12 |
| Schweiz | 0.12 |
| Kroatien | 0.11 |
| **Total** | **95.58** |

| Wirtschaftliche Aufteilung in % des Nettovermögens | |
|---|---|
| Länder- & Zentralregierungen | 54.78 |
| Banken & Kreditinstitute | 7.94 |
| Anlagefonds | 7.33 |
| Finanz- & Beteiligungsgesellschaften | 6.19 |
| Pfandbriefinstitute & Refinanzierungsgesellschaften | 5.79 |
| Supranationale Organisationen | 3.35 |
| Erdöl | 1.49 |
| Telekommunikation | 1.23 |
| Diverse nicht klassierte Gesellschaften | 1.14 |
| Energie- & Wasserversorgung | 0.83 |
| Pharmazeutik, Kosmetik & medizinische Produkte | 0.79 |
| Versicherungen | 0.72 |
| Öffentlich-rechtliche Körperschaften | 0.51 |
| Tabak & alkoholische Getränke | 0.43 |
| Kantone, Bundesstaaten | 0.42 |
| Verkehr & Transport | 0.41 |
| Elektrische Geräte & Komponenten | 0.40 |
| Internet, Software & IT-Dienste | 0.34 |
| Diverse Dienstleistungen | 0.30 |
| Nahrungsmittel & Softdrinks | 0.27 |
| Immobilien | 0.25 |
| Chemie | 0.19 |
| Landwirtschaft & Fischerei | 0.18 |
| Gesundheits- & Sozialwesen | 0.17 |
| Verpackungsindustrie | 0.13 |
| **Total** | **95.58** |

## Nettovermögensaufstellung

| | | CHF |
|---|---|---|
| **Aktiva** | | **30.9.2016** |
| Wertpapierbestand, Einstandswert | 207 292 728.28 | |
| Wertpapierbestand, nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) | 3 527 477.70 | |
| Total Wertpapierbestand (Erläuterung 1) | | 210 820 205.98 |
| Bankguthaben, Sicht- und Fristgelder | | 18 853 342.49 |
| Andere liquide Mittel (Margins) | | 1 559 019.28 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen (Erläuterung 1) | | 13 321 660.84 |
| Forderungen aus Zeichnungen | | 104 267.29 |
| Zinsforderungen aus Wertpapieren | | 1 140 045.66 |
| Zinsforderungen aus liquiden Mitteln | | 2 461.05 |
| Nicht realisierter Kursgewinn (-verlust) aus TBA Mortgage Backed Securities (Erläuterung 1) | | 23 731.16 |
| Nicht realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten (Erläuterung 1) | | 116 927.66 |
| Nicht realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Devisenterminkontrakten (Erläuterung 1) | | 94 012.04 |
| Nicht realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Swaps (Erläuterung 1) | | -46 229.49 |
| **Total Aktiva** | | **245 989 443.96** |
| | | |
| **Passiva** | | |
| Kontokorrentkredit | | -167 858.37 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen (Erläuterung 1) | | -22 300 163.95 |
| Verbindlichkeiten aus Rücknahmen | | -2 810 099.72 |
| Andere Verbindlichkeiten | | -17 739.98 |
| Rückstellungen für pauschale Verwaltungskommission (Erläuterung 2) | -78 736.04 | |
| Rückstellungen für Abonnementsabgabe (Erläuterung 3) | -26 470.83 | |
| Rückstellungen für sonstige Kommissionen und Gebühren (Erläuterung 2) | -18 610.02 | |
| Total Rückstellungen für Aufwendungen | | -123 816.89 |
| **Total Passiva** | | **-25 419 678.91** |
| | | |
| **Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode** | | **220 569 765.05** |

## Ertrags- und Aufwandsrechnung

| | CHF |
|---|---|
| **Erträge** | **1.4.2016-30.9.2016** |
| Zinsertrag auf liquide Mittel | 4 746.55 |
| Zinsen auf Wertpapiere | 1 504 037.89 |
| Dividenden | 5 352.72 |
| Erträge aus Securities Lending (Erläuterung 11) | 28 376.00 |
| Sonstige Erträge | 4 850.07 |
| **Total Erträge** | **1 547 363.23** |
| | |
| **Aufwendungen** | |
| Kosten aus Securities Lending (Erläuterung 11) | -11 350.40 |
| Pauschale Verwaltungskommission (Erläuterung 2) | -680 523.61 |
| Abonnementsabgabe (Erläuterung 3) | -29 550.53 |
| Sonstige Kommissionen und Gebühren (Erläuterung 2) | -8 038.39 |
| Zinsaufwand auf liquide Mittel und Kontokorrentkredit | -639.26 |
| **Total Aufwendungen** | **-730 102.19** |
| | |
| **Nettoerträge (-verluste) aus Anlagen** | **817 261.04** |
| | |
| **Realisierte Gewinne (Verluste) (Erläuterung 1)** | |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus marktbewerteten Wertpapieren ausser Optionen | 1 213 348.85 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten | -460 414.46 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Devisenterminkontrakten | 1 942 026.59 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Swaps | 50 399.26 |
| Realisierter Währungsgewinn (-verlust) | -635 175.84 |
| **Total der realisierten Gewinne (Verluste)** | **2 110 184.40** |
| | |
| **Realisierter Nettogewinn (-verlust) der Berichtsperiode** | **2 927 445.44** |
| | |
| **Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung) (Erläuterung 1)** | |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) marktbewerteter Wertpapiere ausser Optionen | 2 926 097.70 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) renditebewerteter Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 18 997.05 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) von TBA Mortgage Backed Securities | 6 945.07 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) von Finanzterminkontrakten | 269 474.56 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) von Devisenterminkontrakten | -2 800 413.49 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) von Swaps | -46 229.49 |
| **Total der Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung)** | **374 871.40** |
| | |
| **Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens infolge Geschäftstätigkeit** | **3 302 316.84** |

## Veränderungen des Nettovermögens

| | CHF |
|---|---|
| | **1.4.2016-30.9.2016** |
| Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode | 192 416 772.59 |
| Zeichnungen | 122 843 062.89 |
| Rücknahmen | -97 467 476.21 |
| Total Mittelzufluss (-abfluss) | 25 375 586.68 |
| Ausbezahlte Dividende | -524 911.06 |
| Nettoerträge (-verluste) aus Anlagen | 817 261.04 |
| Total der realisierten Gewinne (Verluste) | 2 110 184.40 |
| Total der Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung) | 374 871.40 |
| Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens infolge Geschäftstätigkeit | 3 302 316.84 |
| **Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode** | **220 569 765.05** |

## Entwicklung der Anteile im Umlauf

| | **1.4.2016-30.9.2016** |
|---|---|
| **Klasse** | **(CAD hedged) F-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 0.0000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 57 431.0980 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -50.9830 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **57 380.1150** |
| **Klasse** | **P-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 61 879.5110 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 4 387.9430 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -7 585.3270 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **58 682.1270** |
| **Klasse** | **(CAD hedged) P-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 0.0000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 1 038 475.1000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -1 250.9530 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **1 037 224.1470** |
| **Klasse** | **(EUR hedged) P-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 109 717.8000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 50 677.2800 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -51 280.4280 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **109 114.6520** |
| **Klasse** | **(JPY hedged) P-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 88 589.7640 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 4 457.1730 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -5 151.6800 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **87 895.2570** |
| **Klasse** | **P-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 74 433.9390 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 4 681.3470 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -5 523.6290 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **73 591.6570** |
| **Klasse** | **(CAD hedged) P-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 0.0000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 277 511.1150 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -3 384.3740 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **274 126.7410** |
| **Klasse** | **(EUR hedged) P-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 15 609.3570 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 2 491.4280 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -2 249.6710 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **15 851.1140** |
| **Klasse** | **Q-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 3 740.3860 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 3 421.9310 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -164.5100 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **6 997.8070** |
| **Klasse** | **(CAD hedged) Q-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 0.0000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 73 495.7380 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -400.5010 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **73 095.2370** |
| **Klasse** | **Q-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 10 918.7480 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 6 895.1090 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -3 870.8790 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **13 942.9780** |

| **Klasse** | **(CAD hedged) Q-dist** |
|---|---|
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 0.0000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 11 654.0990 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | 0.0000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **11 654.0990** |
| **Klasse** | **U-X-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 6 360.0000 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 0.0000 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -6 360.0000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **0.0000** |

## Jährliche Ausschüttung

| **UBS (Lux) Bond Fund** | **Ex-Date** | **Pay-Date** | **Währung** | **Betrag pro Anteil** |
|---|---|---|---|---|
| – Global (CHF) P-dist | 1.6.2016 | 6.6.2016 | CHF | 6.59 |
| – Global (CHF) (EUR hedged) P-dist | 1.6.2016 | 6.6.2016 | EUR | 1.48 |
| – Global (CHF) Q-dist | 1.6.2016 | 6.6.2016 | CHF | 0.85 |

# Aufstellung der Wertpapierbestände und anderer Nettovermögenswerte per 30. September 2016

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in CHF NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|
| **Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden** | | | | |
| **Mortgage Backed Securities, variabler Zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | FREMF 2015-K48 MORTGAGE TRUST-144A-SUB VAR 15-01.08.48 | 100 000.00 | 95 541.79 | 0.04 |
| **Total USD** | | | **95 541.79** | **0.04** |
| **Total Mortgage Backed Securities, variabler Zins** | | | **95 541.79** | **0.04** |
| **Notes, fester Zins** | | | | |
| **CAD** | | | | |
| CAD | AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A 5.37500% 04-01.12.34 | 2 500 000.00 | 2 476 362.45 | 1.12 |
| **Total CAD** | | | **2 476 362.45** | **1.12** |
| **EUR** | | | | |
| EUR | ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 4.25000% 14-15.01.22 | 150 000.00 | 166 822.16 | 0.08 |
| EUR | BACARDI LTD-REG-S 2.75000% 13-03.07.23 | 390 000.00 | 482 899.40 | 0.22 |
| EUR | BELGIUM, KINGDOM OF-REG-S 4.00000% 12-28.03.32 | 228 000.00 | 378 696.56 | 0.17 |
| EUR | HEIDELBERGCEMENT FINANCE BV 8.50000% 09-31.10.19 | 105 000.00 | 141 508.54 | 0.06 |
| EUR | TRIONISTA HOLDCO GMBH-REG-S 5.00000% 13-30.04.20 | 380 000.00 | 424 234.79 | 0.19 |
| **Total EUR** | | | **1 594 161.45** | **0.72** |
| **USD** | | | | |
| USD | ACTAVIS FUNDING SCS 4.75000% 15-15.03.45 | 410 000.00 | 434 585.74 | 0.20 |
| USD | AMBER CIRCLE FUNDING LTD-REG-S 3.25000% 12-04.12.22 | 280 000.00 | 285 760.90 | 0.13 |
| USD | ANADARKO PETROLEUM CORP 4.85000% 16-15.03.21 | 80 000.00 | 83 253.47 | 0.04 |
| USD | APT PIPELINES LTD-REG-S 4.20000% 15-23.03.25 | 580 000.00 | 584 342.88 | 0.26 |
| USD | BERKSHIRE HATHAWAY INC 3.12500% 16-15.03.26 | 340 000.00 | 346 425.17 | 0.16 |
| USD | CF INDUSTRIES INC 5.15000% 14-15.03.34 | 410 000.00 | 400 344.68 | 0.18 |
| USD | CNPC GENERAL CAPITAL LTD-REG-S 3.40000% 13-16.04.23 | 300 000.00 | 303 502.66 | 0.14 |
| USD | CONOCOPHILLIPS CO 4.20000% 16-15.03.21 | 220 000.00 | 230 831.05 | 0.10 |
| USD | CVS HEALTH CORP 5.12500% 15-20.07.45 | 605 000.00 | 717 651.89 | 0.33 |
| USD | ENABLE MIDSTREAM PARTNERS LP 3.90000% 15-15.05.24 | 400 000.00 | 361 597.83 | 0.16 |
| USD | ENERGY TRANSFER PARTNERS LP 6.05000% 11-01.06.41 | 450 000.00 | 441 747.00 | 0.20 |
| USD | GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.20000% 16-06.07.21 | 120 000.00 | 117 756.62 | 0.05 |
| USD | HUTCHINSON WHAMPOA INTL 11 LTSD-REG-S 3.50000% 12-13.01.17 | 675 000.00 | 658 365.95 | 0.30 |
| USD | ICELAND, REPUBLIC OF-REG-S 5.87500% 12-11.05.22 | 700 000.00 | 797 236.50 | 0.36 |
| USD | IMPERIAL TOBACCO FINANCE PLC-144A 2.95000% 15-21.07.20 | 280 000.00 | 280 244.58 | 0.13 |
| USD | INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 12-17.01.42 | 460 000.00 | 510 169.16 | 0.23 |
| USD | JPMORGAN CHASE & CO 2.25000% 15-23.01.20 | 430 000.00 | 422 318.47 | 0.19 |
| USD | MOLSON COORS BREWING CO 3.00000% 16-15.07.26 | 50 000.00 | 48 805.70 | 0.02 |
| USD | NEXEN INC 6.40000% 07-15.05.37 | 420 000.00 | 542 610.62 | 0.25 |
| USD | ORACLE CORP 2.40000% 16-15.09.23 | 300 000.00 | 293 152.37 | 0.13 |
| USD | PERRIGO CO 4.00000% 14-15.11.23 | 470 000.00 | 468 460.50 | 0.21 |
| USD | PETROLEOS MEXICANOS 3.50000% 13-30.01.23 | 440 000.00 | 401 690.28 | 0.18 |
| USD | SGSP AUSTRALIA ASSETS PTY LTD-REG-S 3.25000% 16-29.07.26 | 200 000.00 | 197 823.71 | 0.09 |
| USD | SINOPEC CAPITAL 2013 LTD-REG-S 3.12500% 13-24.04.23 | 640 000.00 | 637 471.23 | 0.29 |
| USD | TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 2.80000% 16-21.07.23 | 220 000.00 | 213 815.25 | 0.10 |
| USD | TURKEY, REPUBLIC OF 6.87500% 06-17.03.36 | 715 000.00 | 812 684.37 | 0.37 |
| USD | UNITEDHEALTH GROUP INC 2.70000% 15-15.07.20 | 175 000.00 | 176 267.94 | 0.08 |
| USD | VALERO ENERGY CORP 4.90000% 15-15.03.45 | 120 000.00 | 114 819.35 | 0.05 |
| USD | WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC 3.80000% 14-18.11.24 | 250 000.00 | 260 146.25 | 0.12 |
| USD | WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC 3.10000% 16-01.06.23 | 300 000.00 | 299 965.42 | 0.14 |
| USD | XLIT LTD 5.25000% 13-15.12.43 | 200 000.00 | 212 412.02 | 0.10 |
| USD | ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC 4.45000% 15-15.08.45 | 520 000.00 | 516 234.00 | 0.23 |
| **Total USD** | | | **12 172 493.56** | **5.52** |
| **Total Notes, fester Zins** | | | **16 243 017.46** | **7.36** |
| **Notes, variabler Zins** | | | | |
| **GBP** | | | | |
| GBP | LIVERPOOL VICTORIA FRIENDLY-REG-S-SUB 6.500%/VAR 13-22.05.43 | 150 000.00 | 186 656.82 | 0.09 |
| **Total GBP** | | | **186 656.82** | **0.09** |
| **USD** | | | | |
| USD | ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 5.625%/VAR 14-PRP | 150 000.00 | 142 719.92 | 0.06 |
| USD | ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC-SUB 8.625%/VAR 16-PRP | 300 000.00 | 284 640.08 | 0.13 |
| **Total USD** | | | **427 360.00** | **0.19** |
| **Total Notes, variabler Zins** | | | **614 016.82** | **0.28** |
| **Medium-Term Notes, fester Zins** | | | | |
| **AUD** | | | | |
| AUD | EUROFIMA EUROPEAN RAILROADMAT FIN CO 6.25000% 03-28.12.18 | 945 000.00 | 763 571.63 | 0.35 |
| AUD | EUROPEAN INVESTMENT BANK 6.50000% 09-07.08.19 | 1 155 000.00 | 961 220.73 | 0.43 |
| **Total AUD** | | | **1 724 792.36** | **0.78** |
| **CAD** | | | | |
| CAD | NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV 5.20000% 05-31.03.25 | 2 000 000.00 | 1 785 435.40 | 0.81 |
| **Total CAD** | | | **1 785 435.40** | **0.81** |
| **EUR** | | | | |
| EUR | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV-REG-S 0.87500% 16-17.03.22 | 540 000.00 | 608 742.79 | 0.28 |
| EUR | AUSTRIA, REPUBLIC OF 3.15000% 12-20.06.44 | 418 000.00 | 735 014.78 | 0.33 |
| EUR | BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC-REG-S 0.62500% 16-10.03.21 | 250 000.00 | 278 023.32 | 0.13 |
| EUR | CANAL DE ISABEL II GESTION SA-REG-S 1.68000% 15-26.02.25 | 200 000.00 | 229 711.18 | 0.10 |
| EUR | COCA-COLA HBC FINANCE BV 2.37500% 13-18.06.20 | 240 000.00 | 281 533.62 | 0.13 |
| EUR | CYPRUS GOVERMENT BOND-REG-S 3.75000% 16-26.07.23 | 923 000.00 | 1 032 364.53 | 0.47 |

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in CHF NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|
| EUR | EDP FINANCE BV-REG-S 2.00000% 15-22.04.25 | 200 000.00 | 220 063.34 | 0.10 |
| EUR | ELENIA FINANCE OYJ-REG-S 2.87500% 13-17.12.20 | 520 000.00 | 615 682.77 | 0.28 |
| EUR | EUROPEAN STABILITY MECHANISM-REG-S 1.00000% 15-23.09.25 | 2 140 000.00 | 2 548 342.30 | 1.16 |
| EUR | GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 1.37500% 15-26.07.22 | 505 000.00 | 575 074.85 | 0.26 |
| EUR | NEDERLANDSE GASUNIE NV-REG-S 1.00000% 16-11.05.26 | 180 000.00 | 206 740.06 | 0.09 |
| EUR | NOMURA EUROPE FINANCE NV-REG-S 1.50000% 14-12.05.21 | 350 000.00 | 397 342.77 | 0.18 |
| EUR | NORDEA BANK AB-REG-S 3.25000% 12-05.07.22 | 180 000.00 | 230 787.08 | 0.10 |
| EUR | ORIGIN ENERGY FINANCE LTD-REG-S 2.50000% 13-23.10.20 | 200 000.00 | 228 861.44 | 0.10 |
| EUR | REDEXIS GAS FINANCE BV-REG-S 1.87500% 15-27.04.27 | 460 000.00 | 510 345.16 | 0.23 |
| EUR | REN FINANCE B V-REG-S 2.50000% 15-12.02.25 | 460 000.00 | 543 269.37 | 0.25 |
| EUR | SCENTRE GROUP TRUST 1 / 2-REG-S 1.37500% 16-22.03.23 | 260 000.00 | 300 182.39 | 0.14 |
| EUR | SKY PLC-REG-S 2.50000% 14-15.09.26 | 250 000.00 | 302 796.54 | 0.14 |
| EUR | SNAM SPA-REG-S 1.37500% 15-19.11.23 | 100 000.00 | 117 026.78 | 0.05 |
| EUR | TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD 1.87500% 14-16.09.24 | 120 000.00 | 141 013.89 | 0.06 |
| **Total EUR** | | | **10 102 918.96** | **4.58** |
| **GBP** | | | | |
| GBP | AA BOND CO LTD-REG-S 4.72010% 13-02.07.43 | 460 000.00 | 609 347.59 | 0.28 |
| GBP | ABN AMRO BANK NV 4.87500% 12-16.01.19 | 150 000.00 | 206 338.92 | 0.09 |
| GBP | CPUK FINANCE LTD-REG-S 7.00000% 15-28.08.20 | 220 000.00 | 291 992.26 | 0.13 |
| GBP | GATWICK FUNDING LTD 5.25000% 12-23.01.26 | 170 000.00 | 267 524.39 | 0.12 |
| GBP | GAZ CAPITAL SA/GAZPROM-REG-S LPN 5.33800% 13-25.09.20 | 100 000.00 | 136 187.95 | 0.06 |
| GBP | SOUTHERN GAS NETWORKS PLC-REG-S 2.50000% 15-03.02.25 | 150 000.00 | 203 031.50 | 0.09 |
| GBP | VICINITY CENTRES-REG-S 3.37500% 16-07.04.26 | 150 000.00 | 211 085.66 | 0.10 |
| **Total GBP** | | | **1 925 508.27** | **0.87** |
| **NZD** | | | | |
| NZD | ABN AMRO BANK NV-REG-S 5.75000% 14-17.03.20 | 870 000.00 | 656 364.59 | 0.30 |
| NZD | AUSTRALIA & NZ BANKING GROUP LTD-REG-S 5.62500% 13-22.10.19 | 660 000.00 | 498 142.15 | 0.22 |
| NZD | BNP PARIBAS-REG-S 5.87500% 13-04.12.19 | 610 000.00 | 462 070.73 | 0.21 |
| NZD | INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 3.50000% 16-22.01.21 | 1 200 000.00 | 877 659.86 | 0.40 |
| NZD | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD REG-S 5.62500% 13-22.11.19 | 660 000.00 | 498 275.68 | 0.23 |
| NZD | RABOBANK NEDERLAND NV 5.37500% 14-12.08.19 | 530 000.00 | 394 729.42 | 0.18 |
| **Total NZD** | | | **3 387 242.43** | **1.54** |
| **SEK** | | | | |
| SEK | EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.00000% 12-23.04.19 | 3 680 000.00 | 450 256.55 | 0.20 |
| **Total SEK** | | | **450 256.55** | **0.20** |
| **USD** | | | | |
| USD | AIA GROUP LTD-REG-S 1.75000% 13-13.03.18 | 500 000.00 | 485 534.17 | 0.22 |
| USD | BANK OF AMERICA CORP 3.87500% 15-01.08.25 | 910 000.00 | 942 420.11 | 0.43 |
| USD | CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SOC-REG-S 1.37500% 13-29.01.18 | 665 000.00 | 647 326.30 | 0.29 |
| USD | GENERAL ELECTRIC CO 6.00000% 09-07.08.19 | 202 000.00 | 221 262.91 | 0.10 |
| USD | MEXICO, UNITED STATES OF 4.75000% 12-08.03.44 | 250 000.00 | 252 044.00 | 0.12 |
| USD | MORGAN STANLEY-SUB 4.35000% 14-08.09.26 | 685 000.00 | 708 929.36 | 0.32 |
| **Total USD** | | | **3 257 516.85** | **1.48** |
| **Total Medium-Term Notes, fester Zins** | | | **22 633 670.82** | **10.26** |
| **Medium-Term Notes, variabler Zins** | | | | |
| **EUR** | | | | |
| EUR | ACHMEA BV-REG-S-SUB 4.250%/3M EURIBOR+455BP 15-PRP | 200 000.00 | 204 486.94 | 0.09 |
| EUR | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S-SUB 2.000%/VAR 14-12.11.24 | 260 000.00 | 288 739.20 | 0.13 |
| EUR | NORDEA BANK AB-REG-S-SUB 1.875%/VAR 15-10.11.25 | 180 000.00 | 202 877.01 | 0.09 |
| EUR | TOTAL SA-REG-S-SUB 3.875%/VAR 16-PRP | 260 000.00 | 300 284.35 | 0.14 |
| EUR | UBS AG-REG-S-SUB 4.750%/VAR 14-12.02.26 | 220 000.00 | 255 265.95 | 0.12 |
| **Total EUR** | | | **1 251 653.45** | **0.57** |
| **USD** | | | | |
| USD | ABN AMRO BANK NV-SUB 6.25000% 12-13.09.22 | 500 000.00 | 503 171.92 | 0.23 |
| USD | STANDARD CHARTERED-REG-S-SUB 4.000%/H15T5Y+335BP 12-12.07.22 | 610 000.00 | 597 752.33 | 0.27 |
| **Total USD** | | | **1 100 924.25** | **0.50** |
| **Total Medium-Term Notes, variabler Zins** | | | **2 352 577.70** | **1.07** |
| **Anleihen, fester Zins** | | | | |
| **AUD** | | | | |
| AUD | AUSTRALIA 2.75000% 12-21.04.24 | 827 000.00 | 653 170.98 | 0.30 |
| AUD | AUSTRALIA 4.25000% 14-21.04.26 | 650 000.00 | 580 269.46 | 0.26 |
| AUD | AUSTRALIA-REG-S 3.75000% 14-21.04.37 | 570 000.00 | 505 050.31 | 0.23 |
| **Total AUD** | | | **1 738 490.75** | **0.79** |
| **CAD** | | | | |
| CAD | CANADA, GOVERNMENT 4.00000% 08-01.06.41 | 313 000.00 | 338 869.83 | 0.16 |
| CAD | INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 4.40000% 06-26.01.26 | 2 000 000.00 | 1 792 258.34 | 0.81 |
| CAD | KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 5.05000% 05-04.02.25 | 3 000 000.00 | 2 762 419.35 | 1.25 |
| **Total CAD** | | | **4 893 547.52** | **2.22** |
| **DKK** | | | | |
| DKK | DENMARK, KINGDOM OF 4.50000% 08-15.11.39 | 1 480 000.00 | 406 230.53 | 0.18 |
| **Total DKK** | | | **406 230.53** | **0.18** |
| **EUR** | | | | |
| EUR | AGROKOR DD-REG-S 9.87500% 12-01.05.19 | 214 000.00 | 241 662.15 | 0.11 |
| EUR | AIGUES DE BARCELONA FINANCE SAU-REG-S 1.94400% 14-15.09.21 | 110 000.00 | 125 738.37 | 0.06 |
| EUR | ALBEMARLE CORPORATION-REG-S 1.87500% 14-08.12.21 | 370 000.00 | 426 457.09 | 0.19 |
| EUR | ALSTRIA OFFICE REIT-AG-REG-S 2.25000% 15-24.03.21 | 300 000.00 | 350 900.60 | 0.16 |
| EUR | AON PLC 2.87500% 14-14.05.26 | 280 000.00 | 344 735.62 | 0.16 |
| EUR | BELGIUM, KINGDOM OF 4.25000% 11-28.09.21 | 2 546 000.00 | 3 435 128.17 | 1.56 |
| EUR | BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 3.00000% 14-22.06.34 | 342 000.00 | 522 590.22 | 0.24 |
| EUR | BHARTI AIRTEL INTL NETHERLANDS BV-REG-S 4.00000% 13-10.12.18 | 290 000.00 | 339 292.37 | 0.15 |

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in CHF NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|
| EUR | CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 4.00000% 14-15.07.22 | 240 000.00 | 284 911.67 | 0.13 |
| EUR | FINLAND, REPUBLIC OF-144A-REG-S 0.87500% 15-15.09.25 | 245 000.00 | 288 874.89 | 0.13 |
| EUR | FRANCE, REPUBLIC OF-OAT 2.75000% 12-25.10.27 | 2 419 000.00 | 3 366 447.31 | 1.53 |
| EUR | FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-REG-S 3.25000% 12-25.05.45 | 751 000.00 | 1 282 561.85 | 0.58 |
| EUR | GERMANY, REPUBLIC OF 4.75000% 03-04.07.34 | 513 000.00 | 1 010 433.73 | 0.46 |
| EUR | GERMANY, REPUBLIC OF 3.50000% 09-04.07.19 | 1 050 000.00 | 1 277 522.08 | 0.58 |
| EUR | IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 0.80000% 15-15.03.22 | 9 000.00 | 10 361.61 | 0.00 |
| EUR | ITALY, REPUBLIC OF BTP 4.50000% 13-01.05.23 | 374 000.00 | 509 259.24 | 0.23 |
| EUR | ITALY, REPUBLIC OF-BTP 5.00000% 03-01.08.34 | 865 000.00 | 1 408 234.60 | 0.64 |
| EUR | ITALY, REPUBLIC OF-BTP 4.00000% 05-01.02.37 | 228 000.00 | 337 034.79 | 0.15 |
| EUR | ITALY, REPUBLIC OF-BTP 4.75000% 13-01.09.44 | 1 881 000.00 | 3 158 099.07 | 1.43 |
| EUR | MONDELEZ INTERNATIONAL INC 2.37500% 13-26.01.21 | 290 000.00 | 344 321.98 | 0.16 |
| EUR | NETHERLANDS, KINGDOM OF THE 2.75000% 14-15.01.47 | 144 000.00 | 254 443.87 | 0.12 |
| EUR | PORTUGAL, REPUBLIC OF-144A-REG-S 4.10000% 15-15.02.45 | 1 235 000.00 | 1 311 518.81 | 0.59 |
| EUR | PORTUGAL, REPUBLIC OF-144A-REG-S 2.87500% 15-15.10.25 | 1 900 000.00 | 2 029 623.05 | 0.92 |
| EUR | RESA SA/BELGIUM-REG-S 1.00000% 16-22.07.26 | 100 000.00 | 113 783.60 | 0.05 |
| EUR | SFR GROUP SA-REG-S 5.37500% 14-15.05.22 | 280 000.00 | 314 723.20 | 0.14 |
| EUR | SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 3.45000% 16-30.07.66 | 1 041 000.00 | 1 437 216.54 | 0.65 |
| EUR | TDF INFRASTRUCTURE SAS 2.87500% 15-19.10.22 | 300 000.00 | 363 898.38 | 0.16 |
| EUR | WIND ACQUISITION FINANCE SA-REG-S 4.00000% 14-15.07.20 | 290 000.00 | 320 137.58 | 0.15 |
| **Total EUR** | | | **25 209 912.44** | **11.43** |
| **GBP** | | | | |
| GBP | BUPA FINANCE PLC-REG-S-SUB 5.00000% 13-25.04.23 | 140 000.00 | 192 112.28 | 0.09 |
| GBP | NEW LOOK SENIOR ISSUER PLC-REG-S 6.50000% 15-01.07.22 | 100 000.00 | 116 175.95 | 0.05 |
| GBP | SCOTTISH WIDOWS PLC-REG-S-SUB 5.50000% 13-16.06.23 | 140 000.00 | 191 223.75 | 0.09 |
| GBP | UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 4.25000% 06-07.12.27 | 1 606 000.00 | 2 750 849.71 | 1.25 |
| GBP | UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN & N IRL 3.25000% 12-22.01.44 | 410 000.00 | 717 956.69 | 0.32 |
| GBP | UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 1.50000% 15-22.01.21 | 1 777 000.00 | 2 358 747.26 | 1.07 |
| GBP | UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN-REG-S 1.50000% 16-22.07.26 | 1 000 000.00 | 1 347 398.14 | 0.61 |
| **Total GBP** | | | **7 674 463.78** | **3.48** |
| **JPY** | | | | |
| JPY | JAPAN 1.20000% 14-20.12.34 | 146 750 000.00 | 1 634 975.72 | 0.74 |
| JPY | JAPAN 1.20000% 15-20.09.35 | 803 550 000.00 | 8 950 305.76 | 4.06 |
| JPY | JAPAN 1.50000% 13-20.03.33 | 180 000 000.00 | 2 089 337.72 | 0.95 |
| JPY | JAPAN 1.50000% 15-20.03.45 | 30 000 000.00 | 368 268.62 | 0.17 |
| JPY | JAPAN 1.70000% 03-20.06.33 | 162 000 000.00 | 1 933 798.35 | 0.87 |
| JPY | JAPAN 2.30000% 07-20.06.27 | 200 000 000.00 | 2 397 724.95 | 1.09 |
| **Total JPY** | | | **17 374 411.12** | **7.88** |
| **NZD** | | | | |
| NZD | NEW ZEALAND 6.00000% 13-15.05.21 | 487 000.00 | 393 789.75 | 0.18 |
| **Total NZD** | | | **393 789.75** | **0.18** |
| **USD** | | | | |
| USD | AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 1.62500% 12-04.10.17 | 638 000.00 | 622 416.90 | 0.28 |
| USD | BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 7.12500% 06-20.01.37 | 510 000.00 | 577 205.00 | 0.26 |
| USD | CITIGROUP INC 3.87500% 13-25.10.23 | 620 000.00 | 644 705.30 | 0.29 |
| USD | COLOMBIA, REPUBLIC OF 6.12500% 09-18.01.41 | 400 000.00 | 469 189.60 | 0.21 |
| USD | FMS WERTMANAGEMENT 1.00000% 16-16.08.19 | 490 000.00 | 473 158.23 | 0.22 |
| USD | GAZ CAPITAL SA (GAZPROM)-REG-S LPN 7.28800% 07-16.08.37 | 290 000.00 | 330 674.46 | 0.15 |
| USD | GOLDMAN SACHS GROUP INC-SUB 5.15000% 15-22.05.45 | 500 000.00 | 528 572.14 | 0.24 |
| USD | KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 4.87500% 14-14-10.44 | 300 000.00 | 303 110.05 | 0.14 |
| USD | KOMMUNALBANKEN AS-REG-S 2.12500% 14-15.03.19 | 1 300 000.00 | 1 288 448.93 | 0.58 |
| USD | PACIFIC GAS & ELECTRIC CO 6.05000% 04-01.03.34 | 200 000.00 | 258 540.72 | 0.12 |
| USD | PERU, REPUBLIC OF 8.75000% 03-21.11.33 | 164 000.00 | 257 947.65 | 0.12 |
| USD | PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 5.25000% 09-12.08.19 | 630 000.00 | 671 183.48 | 0.30 |
| USD | REYNOLDS AMERICAN INC 4.45000% 15-12.06.25 | 270 000.00 | 292 027.89 | 0.13 |
| **Total USD** | | | **6 717 180.35** | **3.04** |
| **Total Anleihen, fester Zins** | | | **64 408 026.24** | **29.20** |
| **Anleihen, Nullcoupon** | | | | |
| **EUR** | | | | |
| EUR | GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 16-15.08.26 | 2 300 000.00 | 2 535 363.93 | 1.15 |
| EUR | GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 16-09.04.21 | 3 150 000.00 | 3 529 380.22 | 1.60 |
| **Total EUR** | | | **6 064 744.15** | **2.75** |
| **Total Anleihen, Nullcoupon** | | | **6 064 744.15** | **2.75** |
| **Anleihen, variabler Zins** | | | | |
| **EUR** | | | | |
| EUR | AMERICA MOVIL SAB DE CV-REG-S-SUB 5.12500% 13-06.09.73 | 330 000.00 | 381 097.79 | 0.17 |
| EUR | ENGIE SA-REG-S-SUB 4.750%/VAR 13-PRP | 400 000.00 | 490 444.44 | 0.22 |
| EUR | HSBC HOLDINGS PLC-144A-REG-S-SUB 5.25000%/VAR 14-PRP | 250 000.00 | 266 244.06 | 0.12 |
| EUR | ITALY, REPUBLIC OF 2.550%/CPI LINKED 09-15.09.41 | 994 000.00 | 1 584 040.20 | 0.72 |
| EUR | ITALY, REPUBLIC OF-BTP 2.100%/CPI LINKED 10-15.09.21 | 1 000.00 | 1 325.63 | 0.00 |
| EUR | RABOBANK NEDERLAND NV REG-S-SUB 2.500%/VAR 14-26.05.26 | 250 000.00 | 284 731.37 | 0.13 |
| EUR | ROYAL BANK OF SCOT GP PLC 7.09160%/3M EURIBOR+233BP 07-PRP | 150 000.00 | 161 774.37 | 0.08 |
| EUR | SOCIETE GENERALE-REG-S-SUB 6.750%/VAR 14-PRP | 270 000.00 | 289 396.67 | 0.13 |
| **Total EUR** | | | **3 459 054.53** | **1.57** |
| **GBP** | | | | |
| GBP | ASSICURAZIONI GENERALI-SUB 6.41600%/3M LIBOR+220BP 07-PRP | 150 000.00 | 190 925.68 | 0.09 |
| GBP | CENTRICA PLC-REG-S-SUB 5.250%/VAR 15-10.04.75 | 100 000.00 | 130 044.06 | 0.06 |
| GBP | MELON CAPITAL III-SUB 6.369%/VAR 06-05.09.66 | 200 000.00 | 232 961.36 | 0.10 |
| GBP | ORANGE SA-REG-S-SUB 5.875%/VAR 14-PRP | 100 000.00 | 136 675.28 | 0.06 |
| **Total GBP** | | | **690 606.38** | **0.31** |
| **NZD** | | | | |
| NZD | NEW ZEALAND 2.000%/CPI LINKED 12-20.09.25 | 1 200 000.00 | 918 352.96 | 0.42 |
| **Total NZD** | | | **918 352.96** | **0.42** |

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in CHF NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|
| **SEK** | | | | |
| SEK | SWEDEN, KINGDOM OF 4.000%/CPI LINKED 95-01.12.20 | 6 670 000.00 | 1 222 742.57 | 0.55 |
| **Total SEK** | | | **1 222 742.57** | **0.55** |
| **USD** | | | | |
| USD | AQUARIUS+INV FOR SWISS REIN-REG-S-SUB 6.375%/VAR 13-01.09.24 | 220 000.00 | 223 167.90 | 0.10 |
| USD | QBE INSURANCE GROUP LTD-REG-S-SUB 6.750%/VAR 14-02.12.44 | 360 000.00 | 383 788.18 | 0.18 |
| **Total USD** | | | **606 956.08** | **0.28** |
| **Total Anleihen, variabler Zins** | | | **6 897 712.52** | **3.13** |
| **Treasury-Notes, fester Zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | AMERICA, UNITED STATES OF 3.50000% 09-15.02.39 | 1 235 000.00 | 1 482 481.16 | 0.67 |
| USD | AMERICA, UNITED STATES OF 2.25000% 16-15.08.46 | 2 565 000.00 | 2 441 442.99 | 1.11 |
| USD | AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 16-15.08.26 | 6 750 000.00 | 6 479 801.86 | 2.94 |
| USD | AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 16-31.08.21 | 1 960 000.00 | 1 898 093.58 | 0.86 |
| USD | AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 16-30.06.21 | 475 000.00 | 459 925.34 | 0.21 |
| USD | AMERICA, UNITED STATES OF 0.87500% 12-31.01.17 | 8 900 000.00 | 8 643 241.55 | 3.92 |
| **Total USD** | | | **21 404 986.48** | **9.71** |
| **Total Treasury-Notes, fester Zins** | | | **21 404 986.48** | **9.71** |
| **Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden** | | | **140 714 293.98** | **63.80** |

## Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Treasury-Bills, Nullcoupon** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 16.06.16-15.12.16 | 8 800 000.00 | 8 527 520.98 | 3.87 |
| **Total USD** | | | **8 527 520.98** | **3.87** |
| **Total Treasury-Bills, Nullcoupon** | | | **8 527 520.98** | **3.87** |
| **Asset Backed Securities, fester Zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | AMERICREDIT AUTOMOBILE RECEIVABLE-C 1.93000% 12-08.08.18 | 150 000.00 | 53 749.54 | 0.02 |
| USD | AMERICREDIT AUTOMOBILE RECEIVABLES TRT 2.35000% 12-10.12.18 | 180 000.00 | 175 198.15 | 0.08 |
| USD | CAPITAL AUTO RECEIV ASSET TRUST 2016-1 4.03000% 16-21.08.23 | 135 000.00 | 136 215.31 | 0.06 |
| USD | CAPITAL AUTO RECEIVABLES ASSET TRUST 2.67000% 13-20.02.19 | 400 000.00 | 391 909.81 | 0.18 |
| USD | DRIVE AUTO RECEIVABLES TRT 2015-B-144A 2.12000% 15-17.06.19 | 304 000.00 | 233 934.77 | 0.11 |
| USD | DRIVE AUTO RECEIVABLES TRUST 2015D-144A 3.38000% 15-15.11.21 | 125 000.00 | 123 405.93 | 0.06 |
| USD | DRIVE AUTO RECEIVABLES TST 2016-B-144A 3.19000% 16-15.07.22 | 100 000.00 | 98 665.07 | 0.04 |
| USD | M&T BANK AUTO RECEIVABLES TR-144A-SUB 1.96000% 13-15.11.18 | 175 000.00 | 170 052.53 | 0.08 |
| USD | M&T BANK AUTO RECEIVABLES TR-144A 2.16000% 13-15.03.19 | 225 000.00 | 218 826.46 | 0.10 |
| USD | SANTANDER DRIVE AUTO RECEIV TRST 2014-1 2.36000% 14-15.04.20 | 200 000.00 | 195 328.23 | 0.09 |
| USD | SANTANDER DRIVE AUTO RECEIVALBLES 1.62000% 14-15.02.19 | 225 000.00 | 96 837.30 | 0.04 |
| **Total USD** | | | **1 894 123.10** | **0.86** |
| **Total Asset Backed Securities, fester Zins** | | | **1 894 123.10** | **0.86** |
| **Mortgage Backed Securities, fester Zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | AMERICOLD 2010 LLC TRUST-144A-SUB 7.44300% 10-11.01.29 | 100 000.00 | 108 147.71 | 0.05 |
| USD | CITIGROUP COMM MRTGE TRT 2015-P1-SUB 3.71700% 15-01.09.48 | 170 000.00 | 180 582.05 | 0.08 |
| USD | FANNIE MAE 4.00000% 16-01.02.46 | 250 000.00 | 246 281.95 | 0.11 |
| USD | FANNIE MAE 4.00000% 15-01.10.45 | 175 000.00 | 167 490.91 | 0.08 |
| USD | FANNIE MAE 4.00000% 14-01.11.44 | 125 000.00 | 110 103.32 | 0.05 |
| USD | FANNIE MAE 4.50000% 15-01.11.45 | 25 000.00 | 26 616.10 | 0.01 |
| USD | FANNIE MAE 4.50000% 16-01.07.44 | 150 000.00 | 135 298.20 | 0.06 |
| USD | FANNIE MAE 5.00000% 11-01.01.41 | 148 000.00 | 49 741.79 | 0.02 |
| USD | FANNIE MAE 5.00000% 04-01.03.34 | 705 000.00 | 41 900.10 | 0.02 |
| USD | FANNIE MAE 5.00000% 08-01.07.35 | 322 000.00 | 32 255.91 | 0.01 |
| USD | FANNIE MAE 5.50000% 08-01.04.34 | 891 436.00 | 35 566.71 | 0.02 |
| USD | FREDDIE MAC 3.00000% 16-01.06.46 | 350 000.00 | 348 442.31 | 0.16 |
| USD | FREDDIE MAC 3.50000% 16-01.03.46 | 185 172.00 | 178 537.26 | 0.08 |
| USD | FREDDIE MAC 3.50000% 16-01.04.46 | 175 000.00 | 172 802.07 | 0.08 |
| USD | FREDDIE MAC 3.50000% 15-01.06.45 | 100 000.00 | 100 957.48 | 0.05 |
| USD | FREDDIE MAC 3.50000% 16-01.06.46 | 1 400 000.00 | 1 414 763.76 | 0.64 |
| USD | FREDDIE MAC 4.00000% 16-01.02.46 | 475 000.00 | 451 622.50 | 0.21 |
| USD | FREDDIE MAC 5.50000% 14-01.06.41 | 225 000.00 | 122 707.31 | 0.06 |
| USD | GINNIE MAE 3.00000% 16-01.07.46 | 1 075 000.00 | 1 090 461.35 | 0.49 |
| USD | GINNIE MAE 3.50000% 16-01.05.46 | 950 000.00 | 950 194.01 | 0.43 |
| USD | JPMBB COMM MRTG SEC TRT 2015-C30-SUB 3.82180% 15-01.07.48 | 130 000.00 | 138 382.76 | 0.06 |
| **Total USD** | | | **6 102 855.56** | **2.77** |
| **Total Mortgage Backed Securities, fester Zins** | | | **6 102 855.56** | **2.77** |
| **Mortgage Backed Securities, variabler Zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | CG-CCRE CMCL MRTG TRUST-144A-SUB 1M LIBOR+175BP 14-15.06.31 | 100 000.00 | 96 112.55 | 0.04 |
| USD | COMMERCIAL MTGE PASS-THROUGH-SUB VAR 14-01.02.47 | 190 000.00 | 198 998.63 | 0.09 |
| USD | FREMF 2016-K55 MORTGAGE TRUST-144A-SUB VAR 16-01.04.49 | 125 000.00 | 123 515.78 | 0.05 |
| USD | FREMF MORTGAGE TRUST-144A-SUB FLR 15-01.04.48 | 200 000.00 | 191 829.53 | 0.09 |

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in CHF NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|
| USD | FREMF MORTGAGE TRUST-144A-SUB FLR 15-01.10.48 | 350 000.00 | 337 263.04 | 0.15 |
| USD | JP MORGAN CHASE COM MTGE-144A-SUB 1M LIBOR+250BP 14-15.10.29 | 250 000.00 | 236 528.90 | 0.11 |
| USD | JP MORGAN CHASE COMMERCIAL MORTGAGE-144A-SUB VAR 10-01.11.43 | 100 000.00 | 105 352.73 | 0.05 |
| **Total USD** | | | **1 289 601.16** | **0.58** |
| **Total Mortgage Backed Securities, variabler Zins** | | | **1 289 601.16** | **0.58** |
| **Notes, fester Zins** | | | | |
| **AUD** | | | | |
| AUD | LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 6.25000% 11-13.04.18 | 680 000.00 | 537 351.73 | 0.24 |
| **Total AUD** | | | **537 351.73** | **0.24** |
| **CAD** | | | | |
| CAD | BRITISH COLUMBIA, PROVINCE OF 2.85000% 14-18.06.25 | 1 154 000.00 | 934 617.70 | 0.43 |
| **Total CAD** | | | **934 617.70** | **0.43** |
| **USD** | | | | |
| USD | ABBVIE INC 4.40000% 13-06.11.42 | 335 000.00 | 337 915.62 | 0.15 |
| USD | ANADARKO PETROLEUM CORP 6.37500% 10-15.09.17 | 26 000.00 | 26 276.64 | 0.01 |
| USD | BANK OF AMERICA CORP 3.87500% 12-22.03.17 | 280 000.00 | 274 567.58 | 0.12 |
| USD | CCO LLC/CAPITAL-144A 4.46400% 15-23.07.22 | 250 000.00 | 261 510.68 | 0.12 |
| USD | CCO LLC/CAPITAL-144A 6.48400% 15-23.10.45 | 210 000.00 | 246 186.52 | 0.11 |
| USD | ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 5.20000% 10-01.09.20 | 300 000.00 | 324 724.38 | 0.15 |
| USD | GENERAL ELECTRIC CO 4.12500% 12-09.10.42 | 110 000.00 | 116 698.54 | 0.05 |
| USD | KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 5.00000% 11-01.10.21 | 310 000.00 | 327 900.14 | 0.15 |
| USD | LYB INTERNATIONAL FINANCE BV 5.25000% 13-15.07.43 | 360 000.00 | 396 529.58 | 0.18 |
| USD | MICROSOFT CORP 3.50000% 12-15.11.42 | 470 000.00 | 446 610.43 | 0.20 |
| USD | MORGAN STANLEY 2.65000% 15-27.01.20 | 505 000.00 | 500 249.97 | 0.23 |
| USD | MORGAN STANLEY 6.37500% 12-24.07.42 | 380 000.00 | 501 940.00 | 0.23 |
| USD | PHILLIPS 66 PARTNERS LP 4.68000% 15-15.02.45 | 180 000.00 | 165 325.59 | 0.07 |
| USD | PPL CAPITAL FUNDING INC 4.70000% 13-01.06.43 | 150 000.00 | 157 675.48 | 0.07 |
| USD | QUICKEN LOANS INC -144A 5.75000% 15-01.05.25 | 220 000.00 | 211 668.49 | 0.10 |
| USD | SCHLUMBERGER HOLDINGS CORP-144A 3.00000% 15-21.12.20 | 300 000.00 | 303 247.90 | 0.14 |
| USD | SOUTHWESTERN ELECTRIC POWER 6.20000% 10-15.03.40 | 130 000.00 | 161 976.21 | 0.07 |
| USD | SPRINT CORP 7.25000% 14-15.09.21 | 200 000.00 | 194 607.05 | 0.09 |
| USD | SUNTRUST BANKS INC 2.35000% 13-01.11.18 | 220 000.00 | 216 945.38 | 0.10 |
| USD | TEACHERS INSURANCE&ANNUITY ASS-144A-SUB 4.90000% 14-15.09.44 | 520 000.00 | 566 954.33 | 0.26 |
| USD | VERIZON COMMUNICATIONS INC 5.15000% 13-15.09.23 | 115 000.00 | 129 867.23 | 0.06 |
| USD | VERIZON COMMUNICATIONS INC 6.55000% 13-15.09.43 | 705 000.00 | 924 051.40 | 0.42 |
| USD | XCEL ENERGY INC 4.80000% 11-15.09.41 | 120 000.00 | 135 628.33 | 0.06 |
| **Total USD** | | | **6 929 057.47** | **3.14** |
| **Total Notes, fester Zins** | | | **8 401 026.90** | **3.81** |
| **Medium-Term Notes, fester Zins** | | | | |
| **AUD** | | | | |
| AUD | ADANI ABBOT POINT TERMINAL PTY LTD STEP-UP 13-01.11.18 | 240 000.00 | 177 244.17 | 0.08 |
| AUD | LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTEBANK 5.50000% 12-09.03.20 | 470 000.00 | 387 551.40 | 0.18 |
| **Total AUD** | | | **564 795.57** | **0.26** |
| **GBP** | | | | |
| GBP | NATIONAL GRID ELECTRICITY TRANSMISSION 4.00000% 12-08.06.27 | 120 000.00 | 186 185.75 | 0.08 |
| **Total GBP** | | | **186 185.75** | **0.08** |
| **USD** | | | | |
| USD | ONCOR ELECTRIC DELIVERY CO 7.00000% 02-01.05.32 | 55 000.00 | 75 185.71 | 0.03 |
| **Total USD** | | | **75 185.71** | **0.03** |
| **Total Medium-Term Notes, fester Zins** | | | **826 167.03** | **0.37** |
| **Anleihen, fester Zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA-REG-S 2.25000% 12-16.03.17 | 500 000.00 | 487 176.82 | 0.22 |
| USD | DUKE ENERGY CAROLINAS LLC 4.00000% 12-30.09.42 | 110 000.00 | 114 298.32 | 0.05 |
| USD | PACIFICORP 6.00000% 09-15.01.39 | 150 000.00 | 198 060.64 | 0.09 |
| USD | THE EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 2.87500% 13-17.09.18 | 490 000.00 | 488 263.42 | 0.22 |
| **Total USD** | | | **1 287 799.20** | **0.58** |
| **Total Anleihen, fester Zins** | | | **1 287 799.20** | **0.58** |
| **Anleihen, variabler Zins** | | | | |
| **NZD** | | | | |
| NZD | NEW ZEALAND 3.000%/CPI LINKED 13-20.09.30 | 1 850 000.00 | 1 565 086.47 | 0.71 |
| NZD | NEW ZEALAND-REG-S 2.500%/CPI LINKED 14-20.09.35 | 900 000.00 | 717 248.91 | 0.33 |
| **Total NZD** | | | **2 282 335.38** | **1.04** |
| **Total Anleihen, variabler Zins** | | | **2 282 335.38** | **1.04** |
| **Treasury-Notes, fester Zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 12-15.08.42 | 1 254 000.00 | 1 324 654.80 | 0.60 |
| USD | AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 15-15.08.45 | 640 000.00 | 691 036.71 | 0.32 |
| USD | AMERICA, UNITED STATES OF 0.75000% 16-15.08.19 | 1 240 000.00 | 1 197 876.45 | 0.54 |
| USD | AMERICA, UNITED STATES OF 0.75000% 14-15.01.17 | 8 800 000.00 | 8 541 067.76 | 3.87 |
| **Total USD** | | | **11 754 635.72** | **5.33** |
| **Total Treasury-Notes, fester Zins** | | | **11 754 635.72** | **5.33** |

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in CHF NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|
| **Treasury-Notes, variabler Zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | AMERICA, UNITED STATES OF 0.750%/CPI LINKED 15-15.02.45 | 5 964 000.00 | 6 090 250.59 | 2.76 |
| USD | AMERICA, UNITED STATES OF 0.125%/CPI LINKED 13-15.01.23 | 3 230 000.00 | 3 316 101.60 | 1.50 |
| **Total USD** | | | **9 406 352.19** | **4.26** |
| **Total Treasury-Notes, variabler Zins** | | | **9 406 352.19** | **4.26** |
| **Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | **51 772 417.22** | **23.47** |

## Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht an einer offiziellen Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Asset Backed Securities, fester Zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | AMERICREDIT AUTOMOBILE RECEIVABLE 16-1 3.59000% 16-08.02.22 | 150 000.00 | 150 519.07 | 0.07 |
| USD | CAPITAL AUTO RECEI ASSET TRT 3.16000% 16-20.11.23 | 125 000.00 | 123 204.52 | 0.06 |
| USD | SANTANDER DRIVE AUTO REC TRUST 2016-2 3.39000% 16-15.04.22 | 75 000.00 | 75 131.38 | 0.03 |
| **Total USD** | | | **348 854.97** | **0.16** |
| **Total Asset Backed Securities, fester Zins** | | | **348 854.97** | **0.16** |
| **Mortgage Backed Securities, fester Zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | FREDDIE MAC 3.00000% 16-01.08.46 | 725 000.00 | 728 901.61 | 0.33 |
| USD | FREDDIE MAC 3.50000% 16-01.03.46 | 650 803.00 | 611 497.49 | 0.28 |
| USD | FREDDIE MAC GOLD POOL 3.50000% 16-01.01.46 | 500 000.00 | 469 246.78 | 0.21 |
| **Total USD** | | | **1 809 645.88** | **0.82** |
| **Total Mortgage Backed Securities, fester Zins** | | | **1 809 645.88** | **0.82** |
| **Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht an einer offiziellen Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | **2 158 500.85** | **0.98** |

## OGAW/Andere OGA im Sinne des Artikels 41 (1) e) des abgeänderten luxemburgischen Gesetzes vom 17. Dezember 2010

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Investment Fonds, open end** | | | | |
| **Irland** | | | | |
| GBP | UBS (IRL) SELECT MONEY MARKET FUND-GBP-S-DIST | 151.26 | 1 904 679.49 | 0.86 |
| USD | UBS IRL SELECT MONEY MARKET FUND - USD-S-DIST | 1 472.08 | 14 270 314.44 | 6.47 |
| **Total Irland** | | | **16 174 993.93** | **7.33** |
| **Total Investment Fonds, open end** | | | **16 174 993.93** | **7.33** |
| **Total OGAW/Andere OGA im Sinne des Artikels 41 (1) e) des abgeänderten luxemburgischen Gesetzes vom 17. Dezember 2010** | | | **16 174 993.93** | **7.33** |
| **Total des Wertpapierbestandes** | | | **210 820 205.98** | **95.58** |

## To Be Announced («TBA») Mortgage Backed Securities (Erläuterung 1)

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **TBA Mortgage Backed Securities** | | | | |
| USD | FREDDIE MAC (TBA-US02R0306A65) 3.00000% OCT 16 13.10.16 | 2 425 000.00 | 7 963.45 | 0.00 |
| USD | FANNIE MAE (TBA-US02R0326A20) 3.50000% OCT 16 13.10.16 | 625 000.00 | 615.36 | 0.00 |
| USD | FANNIE MAE (TBA-US01F0306A11) 3.00000% OCT 44 01.10.44 | 1 850 000.00 | 7 653.93 | 0.00 |
| USD | FREDDIE MAC (TBA-US02R0426A11) 4.50000% OCT 16 13.10.16 | 1 125 000.00 | 957.52 | 0.00 |
| USD | FREDDIE MAC (TBA-US02R0406A56) 4.00000% OCT 44 01.10.44 | 250 000.00 | 411.80 | 0.00 |
| USD | FANNIE MAE (TBA-US01F0426A65) 4.50000% OCT 16 13.10.16 | 775 000.00 | -228.00 | 0.00 |
| USD | FANNIE MAE (TBA-US01F0406A02) 4.00000% OCT 16 13.10.16 | 2 350 000.00 | 2 798.49 | 0.00 |
| USD | GINNIE MAE (TBA-US21H0326A37) 3.50000% OCT 16 20.10.16 | 725 000.00 | 713.85 | 0.00 |
| USD | GINNIE MAE (TBA-US21H0406A63) 4.00000% OCT 16 20.10.16 | 625 000.00 | 544.32 | 0.00 |
| USD | GINNIE MAE (TBA-US21H0306A72) 3.00000% OCT 44 01.10.44 | 1 025 000.00 | 2 300.44 | 0.01 |
| **Total TBA Mortgage Backed Securities** | | | **23 731.16** | **0.01** |
| **Total To Be Announced («TBA») Mortgage Backed Securities (Erläuterung 1)** | | | **23 731.16** | **0.01** |

# Derivative Instrumente

## Derivative Instrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Financial Futures auf Anleihen** | | | | |
| USD | US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.12.16 | -36.00 | 8 875.93 | 0.00 |
| USD | US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 20.12.16 | -56.00 | 93 335.04 | 0.04 |
| CAD | CANADA 10YR BOND FUTURE 19.12.16 | -53.00 | -43 784.35 | -0.02 |
| USD | US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.12.16 | 27.00 | 4 907.74 | 0.00 |
| GBP | LONG GILT FUTURE 28.12.16 | -38.00 | 32 136.08 | 0.01 |
| EUR | EURO-BUND FUTURE 08.12.16 | -31.00 | -10 610.87 | 0.00 |
| JPY | JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (TSE) FUTURE 13.12.16 | -4.00 | -30 633.29 | -0.01 |
| AUD | AUSTRALIA 3YR BOND FUTURE 15.12.16 | 243.00 | 46 135.94 | 0.02 |
| AUD | AUSTRALIA 10Y BOND FUT 15.12.16 | 23.00 | 23 123.70 | 0.01 |
| EUR | EURO-BUXL FUTURE 08.12.16 | -6.00 | -6 275.01 | 0.00 |

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in CHF NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|
| EUR | EURO-BOBL FUTURE 08.12.16 | -14.00 | 762.59 | 0.00 |
| EUR | EURO-OAT FUTURE 08.12.16 | -6.00 | -1 045.84 | 0.00 |
| **Total Financial Futures auf Anleihen** | | | **116 927.66** | **0.05** |
| **Total Derivative Instrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden** | | | **116 927.66** | **0.05** |

## Derivative Instrumente, die nicht an einer offiziellen Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

**Swaps und Forward-Swaps auf Zinssätze**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| GBP | LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 1.09100% 16-03.07.46 | -525 000.00 | -12 501.83 | -0.01 |
| GBP | LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6ML 16-03.07.46 | | | |
| GBP | LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 0.87800% 16-06.08.46 | -350 000.00 | 16 951.11 | 0.01 |
| GBP | LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6ML 16-06.08.46 | | | |
| GBP | LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 0.96600% 16-22.08.46 | -620 000.00 | 11 700.51 | 0.01 |
| GBP | LCH/INTEREST RATE SWAP REC 6ML 16-22.08.46 | | | |
| NZD | LCH/INTEREST RATE SWAP REC 2.25800% 16-16.05.19 | 6 000 000.00 | 51 910.11 | 0.03 |
| NZD | LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 3MF 16-16.05.19 | | | |
| NZD | LCH/INTEREST RATE SWAP REC 2.34750% 16-27.05.19 | 9 000 000.00 | 94 762.47 | 0.04 |
| NZD | LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER 3MF 16-27.05.19 | | | |
| MXN | CME/INTEREST RATE SWAP REC 6.28000% 16-23.07.26 | 60 000 000.00 | -26 218.39 | -0.01 |
| MXN | CME/INTEREST RATE SWAP PAYER MXI 16-23.07.26 | | | |
| MXN | CME/INTEREST RATE SWAP REC 6.42100% 16-14.09.26 | 60 000 000.00 | 5 118.67 | 0.00 |
| MXN | CME/INTEREST RATE SWAP PAYER MXI 16-14.09.26 | | | |
| **Total Swaps und Forward-Swaps auf Zinssätze** | | | **141 722.65** | **0.07** |

**Credit-Default-Swaps***

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| EUR | ICE/ITRX EUR XOVER 25 CDI PAYER 5.00000% 16-20.06.21 | -2 150 000.00 | -187 952.14 | -0.09 |
| **Total Credit-Default-Swaps** | | | **-187 952.14** | **-0.09** |
| **Total Derivative Instrumente, die nicht an einer offiziellen Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | **-46 229.49** | **-0.02** |
| **Total Derivative Instrumente** | | | **70 698.17** | **0.03** |

## Devisenterminkontrakte

**Devisenterminkontrakte (Kauf/Verkauf)**

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| USD | 604 067.17 | TWD | 19 100 000.00 | 5.10.2016 | -5 579.56 | 0.00 |
| MYR | 5 050 000.00 | USD | 1 245 929.14 | 5.10.2016 | -23 778.54 | -0.01 |
| USD | 1 776 392.96 | KRW | 1 984 000 000.00 | 5.10.2016 | -23 925.18 | -0.01 |
| CNY | 3 975 000.00 | USD | 594 516.98 | 11.10.2016 | 1 326.18 | 0.00 |
| CHF | 8 979 142.75 | JPY | 939 800 000.00 | 5.10.2016 | -17 120.37 | -0.01 |
| JPY | 1 000 840 400.00 | CHF | 9 562 341.79 | 5.10.2016 | 18 232.35 | 0.01 |
| CHF | 198 493.30 | DKK | 1 350 000.00 | 5.10.2016 | 987.46 | 0.00 |
| CHF | 11 140 646.55 | GBP | 8 670 000.00 | 5.10.2016 | 223 754.43 | 0.10 |
| CHF | 48 164 924.81 | USD | 49 140 000.00 | 5.10.2016 | 534 834.83 | 0.24 |
| CHF | 4 031 733.75 | CAD | 5 375 000.00 | 5.10.2016 | 67 523.78 | 0.03 |
| CHF | 3 913 262.91 | AUD | 5 310 000.00 | 5.10.2016 | -25 177.13 | -0.01 |
| MXN | 28 070 000.00 | CHF | 1 459 114.14 | 5.10.2016 | -53 697.92 | -0.02 |
| SEK | 15 050 000.00 | CHF | 1 729 301.67 | 5.10.2016 | -26 404.65 | -0.01 |
| NOK | 13 400 000.00 | CHF | 1 573 878.32 | 5.10.2016 | 51 228.44 | 0.02 |
| CHF | 35 687 874.48 | EUR | 32 605 000.00 | 5.10.2016 | 168 349.92 | 0.08 |
| EUR | 17 420 600.00 | CHF | 19 067 756.06 | 5.10.2016 | -89 948.07 | -0.04 |
| CHF | 10 232 014.47 | NZD | 14 465 000.00 | 5.10.2016 | 37 237.53 | 0.02 |
| EUR | 125 000.00 | CHF | 137 115.63 | 11.10.2016 | -947.73 | 0.00 |
| EUR | 825 000.00 | CHF | 904 140.60 | 11.10.2016 | -5 432.45 | 0.00 |
| JPY | 13 100 000.00 | CHF | 124 197.46 | 5.10.2016 | 1 202.67 | 0.00 |
| EUR | 125 600.00 | CHF | 137 164.87 | 11.10.2016 | -343.36 | 0.00 |
| CHF | 2 276 423.38 | JPY | 240 200 000.00 | 5.10.2016 | -22 898.18 | -0.01 |
| EUR | 2 120 000.00 | CHF | 2 316 962.84 | 5.10.2016 | -7 458.41 | 0.00 |
| AUD | 795 000.00 | MXN | 11 217 052.50 | 5.10.2016 | 28 046.72 | 0.01 |
| CAD | 773 885.53 | EUR | 535 000.00 | 11.10.2016 | -12 160.68 | -0.01 |
| CHF | 152 413.24 | EUR | 140 000.00 | 5.10.2016 | -101.20 | 0.00 |
| CAD | 390 000.00 | MXN | 5 565 729.00 | 5.10.2016 | 8 973.02 | 0.00 |
| CHF | 202 958.77 | JPY | 21 330 500.00 | 11.10.2016 | -1 212.14 | 0.00 |
| EUR | 750 000.00 | CHF | 822 486.75 | 5.10.2016 | -5 445.09 | 0.00 |
| AUD | 780 000.00 | USD | 586 248.00 | 5.10.2016 | 10 294.74 | 0.00 |
| EUR | 170 000.00 | CHF | 185 784.50 | 5.10.2016 | -588.39 | 0.00 |
| USD | 215 000.00 | CHF | 209 237.79 | 5.10.2016 | -844.03 | 0.00 |
| AUD | 160 000.00 | CHF | 116 938.56 | 5.10.2016 | 1 733.83 | 0.00 |
| NZD | 165 000.00 | CHF | 117 199.50 | 5.10.2016 | -909.27 | 0.00 |
| EUR | 115 000.00 | CHF | 125 887.05 | 5.10.2016 | -607.33 | 0.00 |
| USD | 165 000.00 | CHF | 160 813.46 | 5.10.2016 | -883.37 | 0.00 |
| CHF | 46 964.17 | JPY | 4 951 400.00 | 11.10.2016 | -429.55 | 0.00 |
| CHF | 360 140.60 | EUR | 329 400.00 | 11.10.2016 | 1 310.95 | 0.00 |
| CAD | 980 000.00 | CHF | 728 928.90 | 5.10.2016 | -6 152.01 | 0.00 |
| EUR | 520 000.00 | NOK | 4 804 648.68 | 5.10.2016 | -16 211.37 | -0.01 |
| EUR | 520 000.00 | NOK | 4 744 584.00 | 5.10.2016 | -8 926.02 | 0.00 |
| GBP | 450 000.00 | USD | 590 158.80 | 5.10.2016 | -5 405.18 | 0.00 |
| CHF | 4 716 438.55 | GBP | 3 725 000.00 | 5.10.2016 | 26 078.32 | 0.01 |
| CHF | 9 784 496.21 | CAD | 13 185 000.00 | 5.10.2016 | 60 196.97 | 0.03 |
| CHF | 23 812 795.86 | EUR | 21 910 000.00 | 5.10.2016 | -55 714.58 | -0.03 |
| SEK | 17 600 000.00 | CHF | 1 995 660.12 | 5.10.2016 | -4 232.37 | 0.00 |
| CHF | 6 196 465.77 | JPY | 645 800 000.00 | 5.10.2016 | 14 526.29 | 0.01 |
| CNY | 3 460 000.00 | USD | 518 585.13 | 11.10.2016 | 94.20 | 0.00 |
| USD | 509 207.37 | TWD | 15 900 000.00 | 5.10.2016 | 1 501.30 | 0.00 |
| MYR | 4 902 000.00 | USD | 1 197 800.86 | 5.10.2016 | -11 823.12 | -0.01 |
| CHF | 36 042 952.70 | USD | 37 300 000.00 | 5.10.2016 | -110 941.40 | -0.05 |
| NOK | 2 500 000.00 | CHF | 298 229.99 | 5.10.2016 | 4 961.57 | 0.00 |

* Nominal positiv: der Subfonds ist «Receiver», Nominal negativ: der Subfonds ist «Payer».

| Bezeichnung | | | | | Anzahl/ Nominal | Bewertung in CHF NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| USD | 1 590 227.95 | KRW | 1 751 000 000.00 | 5.10.2016 | | 655.53 | 0.00 |
| MXN | 11 140 000.00 | CHF | 548 343.84 | 5.10.2016 | | 9 416.64 | 0.00 |
| CHF | 918 866.00 | NZD | 1 300 000.00 | 5.10.2016 | | 2 639.94 | 0.00 |
| CHF | 219 299.05 | DKK | 1 500 000.00 | 5.10.2016 | | -151.89 | 0.00 |
| CHF | 218 657.70 | USD | 225 000.00 | 5.10.2016 | | 571.21 | 0.00 |
| CAD | 136 705 400.00 | CHF | 101 448 120.40 | 5.10.2016 | | -624 137.34 | -0.29 |
| CAD | 6 120 800.00 | CHF | 4 508 569.04 | 5.10.2016 | | 5 688.89 | 0.00 |
| CHF | 17 468 584.23 | USD | 18 050 000.00 | 5.10.2016 | | -26 798.84 | -0.01 |
| CHF | 329 514.30 | CAD | 450 000.00 | 5.10.2016 | | -2 373.05 | 0.00 |
| NZD | 1 310 000.00 | CHF | 927 355.55 | 5.10.2016 | | -4 081.59 | 0.00 |
| CHF | 288 305.43 | EUR | 265 000.00 | 5.10.2016 | | -382.62 | 0.00 |
| CHF | 592 136.15 | USD | 610 000.00 | 5.10.2016 | | 879.44 | 0.00 |
| USD | 1 116 213.80 | TWD | 35 000 000.00 | 3.11.2016 | | -4 663.09 | 0.00 |
| MYR | 9 952 000.00 | USD | 2 410 911.12 | 3.11.2016 | | -3 555.81 | 0.00 |
| KRW | 3 735 000 000.00 | USD | 3 391 200.13 | 5.10.2016 | | -561.37 | 0.00 |
| TWD | 35 000 000.00 | USD | 1 115 004.78 | 5.10.2016 | | 2 405.64 | 0.00 |
| USD | 2 411 787.51 | MYR | 9 952 000.00 | 5.10.2016 | | 4 635.83 | 0.00 |
| USD | 3 389 784.36 | KRW | 3 735 000 000.00 | 3.11.2016 | | 1 109.23 | 0.00 |
| CNY | 7 435 000.00 | USD | 1 112 407.80 | 3.11.2016 | | -166.32 | 0.00 |
| USD | 1 114 442.03 | CNY | 7 435 000.00 | 11.10.2016 | | -121.47 | 0.00 |
| GBP | 11 945 000.00 | CHF | 15 080 793.04 | 5.10.2016 | | -40 161.39 | -0.02 |
| NZD | 14 290 000.00 | CHF | 10 059 395.49 | 5.10.2016 | | 12 043.33 | 0.01 |
| CHF | 17 311 234.06 | JPY | 1 812 700 000.00 | 4.11.2016 | | -31 066.76 | -0.01 |
| CHF | 10 031 590.00 | NZD | 14 290 000.00 | 3.11.2016 | | -8 779.01 | 0.00 |
| CHF | 15 064 587.26 | GBP | 11 945 000.00 | 3.11.2016 | | 41 785.49 | 0.02 |
| JPY | 1 812 700 000.00 | CHF | 17 318 680.05 | 5.10.2016 | | 33 443.97 | 0.02 |
| MXN | 22 430 000.00 | CHF | 1 116 013.34 | 3.11.2016 | | 1 073.54 | 0.00 |
| SEK | 32 650 000.00 | CHF | 3 690 441.06 | 3.11.2016 | | 2 771.49 | 0.00 |
| CHF | 3 691 246.30 | SEK | 32 650 000.00 | 5.10.2016 | | -3 078.47 | 0.00 |
| CHF | 1 120 717.75 | MXN | 22 427 218.50 | 5.10.2016 | | -2 174.19 | 0.00 |
| CHF | 764 244.62 | NOK | 6 350 767.32 | 5.10.2016 | | -5 955.00 | 0.00 |
| NOK | 6 360 000.00 | CHF | 764 249.01 | 3.11.2016 | | 5 733.63 | 0.00 |
| CAD | 142 826 200.00 | CHF | 105 689 959.74 | 3.11.2016 | | -519 662.16 | -0.24 |
| CHF | 105 831 357.68 | CAD | 142 826 200.00 | 5.10.2016 | | 493 116.69 | 0.22 |
| CHF | 1 298.33 | USD | 1 339.92 | 11.10.2016 | | -0.08 | 0.00 |
| CHF | 102 761 277.05 | USD | 106 185 000.00 | 3.11.2016 | | 27 967.72 | 0.01 |
| CHF | 415 883.60 | DKK | 2 850 000.00 | 3.11.2016 | | -922.22 | 0.00 |
| DKK | 2 850 000.00 | CHF | 416 023.29 | 5.10.2016 | | 933.49 | 0.00 |
| USD | 106 179 658.75 | CHF | 102 918 138.17 | 5.10.2016 | | -1 029.91 | 0.00 |
| CHF | 451 378.07 | EUR | 415 000.00 | 11.10.2016 | | -699.36 | 0.00 |
| CHF | 574 079.12 | CAD | 773 885.53 | 11.10.2016 | | 3 440.42 | 0.00 |
| AUD | 3 575 000.00 | CHF | 2 660 598.30 | 5.10.2016 | | -9 012.02 | 0.00 |
| CHF | 2 654 548.33 | AUD | 3 575 000.00 | 3.11.2016 | | 9 711.99 | 0.00 |
| CAD | 17 640 000.00 | CHF | 13 090 185.36 | 5.10.2016 | | -80 201.40 | -0.04 |
| CHF | 12 500 838.70 | CAD | 16 870 000.00 | 3.11.2016 | | 78 587.60 | 0.04 |
| CHF | 54 705 987.18 | EUR | 50 310 000.00 | 3.11.2016 | | -81 250.09 | -0.04 |
| EUR | 50 725 000.00 | CHF | 55 177 792.68 | 5.10.2016 | | 81 458.45 | 0.04 |
| EUR | 17 216 800.00 | CHF | 18 721 169.55 | 3.11.2016 | | 27 804.94 | 0.01 |
| CHF | 18 949 832.53 | EUR | 17 420 600.00 | 5.10.2016 | | -27 975.46 | -0.01 |
| EUR | 203 800.00 | CHF | 221 664.70 | 11.10.2016 | | 343.45 | 0.00 |
| CHF | 9 551 881.38 | JPY | 1 000 840 400.00 | 5.10.2016 | | -28 692.76 | -0.01 |
| JPY | 974 558 500.00 | CHF | 9 297 891.52 | 4.11.2016 | | 25 817.13 | 0.01 |
| JPY | 26 281 900.00 | CHF | 250 832.47 | 11.10.2016 | | 732.17 | 0.00 |
| USD | 595 255.92 | CNY | 3 975 000.00 | 11.10.2016 | | -609.91 | 0.00 |
| KRW | 1 984 000 000.00 | USD | 1 800 362.98 | 5.10.2016 | | 684.27 | 0.00 |
| USD | 1 218 159.01 | MYR | 5 050 000.00 | 5.10.2016 | | -3 141.03 | 0.00 |
| USD | 1 182 458.51 | MYR | 4 902 000.00 | 5.10.2016 | | -3 048.97 | 0.00 |
| USD | 518 134.72 | CNY | 3 460 000.00 | 11.10.2016 | | -530.89 | 0.00 |
| KRW | 1 751 000 000.00 | USD | 1 588 929.22 | 5.10.2016 | | 603.91 | 0.00 |
| MYR | 9 952 000.00 | USD | 2 400 617.52 | 5.10.2016 | | 6 191.58 | 0.00 |
| CNY | 7 435 000.00 | USD | 1 113 390.64 | 11.10.2016 | | 1 140.67 | 0.00 |
| USD | 3 389 292.20 | KRW | 3 735 000 000.00 | 5.10.2016 | | -1 287.75 | 0.00 |
| CHF | 2 299 619.27 | EUR | 2 111 800.00 | 3.11.2016 | | -116.12 | 0.00 |
| CHF | 7 507 990.75 | USD | 7 750 000.00 | 3.11.2016 | | 9 915.25 | 0.00 |
| **Total Devisenterminkontrakte (Kauf/Verkauf)** | | | | | | **94 012.04** | **0.04** |

| | | |
|---|---|---|
| **Bankguthaben, Sicht- und Fristgelder und andere liquide Mittel** | **20 412 361.77** | **9.25** |
| **Kontokorrentkredit und andere kurzfristige Verbindlichkeiten** | **-167 858.37** | **-0.08** |
| **Andere Aktiva und Passiva** | **-10 683 385.70** | **-4.83** |
| **Total des Nettovermögens** | **220 569 765.05** | **100.00** |

# UBS (Lux) Bond Fund – USD

## Wichtigste Daten

| | ISIN | 30.9.2016 | 31.3.2016 | 31.3.2015 |
|---|---|---|---|---|
| Nettovermögen in USD | | 108 626 425.77 | 120 827 476.31 | 163 935 319.82 |
| **Klasse F-acc** | **LU0415176030** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 13 761.3760 | 28 565.6510 | 57 772.2250 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in USD | | 317.74 | 311.07 | 303.86 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in USD[1] | | 317.74 | 311.07 | 303.86 |
| **Klasse P-acc** | **LU0035346773** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 262 381.4300 | 289 617.0560 | 396 250.2890 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in USD | | 311.65 | 306.03 | 300.74 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in USD[1] | | 311.65 | 306.03 | 300.74 |
| **Klasse P-dist** | **LU0035346344** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 183 753.9200 | 196 295.6170 | 252 450.7120 |
| Nettoinventarwert pro Anteil in USD | | 106.46 | 106.98 | 107.79 |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in USD[1] | | 106.46 | 106.98 | 107.79 |
| **Klasse Q-acc[2]** | **LU0415176204** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 21 213.9560 | 17 148.2310 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in USD | | 104.67 | 102.58 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in USD[1] | | 104.67 | 102.58 | - |
| **Klasse Q-dist[2]** | **LU0415176113** | | | |
| Anteile im Umlauf | | 6 752.1670 | 5 363.4070 | - |
| Nettoinventarwert pro Anteil in USD | | 103.74 | 102.59 | - |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in USD[1] | | 103.74 | 102.59 | - |

[1] Siehe Erläuterung 1
[2] Erste NAV 19.11.2015

## Struktur des Wertpapierbestandes

| Geographische Aufteilung in % des Nettovermögens | |
|---|---|
| Vereinigte Staaten | 40.24 |
| Supranational | 15.01 |
| Deutschland | 7.17 |
| Frankreich | 5.31 |
| Kanada | 4.26 |
| Grossbritannien | 3.69 |
| Niederlande | 2.93 |
| Südkorea | 2.54 |
| Japan | 1.95 |
| Australien | 1.94 |
| Cayman-Inseln | 1.81 |
| Katar | 1.53 |
| Norwegen | 1.51 |
| Irland | 1.46 |
| Britische Jungferninseln | 1.38 |
| Belgien | 1.29 |
| Schweden | 1.26 |
| Chile | 0.99 |
| Luxemburg | 0.68 |
| Jersey | 0.61 |
| Hongkong | 0.47 |
| **Total** | **98.03** |

| Wirtschaftliche Aufteilung in % des Nettovermögens | |
|---|---|
| Banken & Kreditinstitute | 21.54 |
| Finanz- & Beteiligungsgesellschaften | 18.32 |
| Supranationale Organisationen | 15.01 |
| Pfandbriefinstitute & Refinanzierungsgesellschaften | 8.04 |
| Computer & Netzwerkausrüster | 7.06 |
| Erdöl | 4.48 |
| Internet, Software & IT-Dienste | 4.21 |
| Länder- & Zentralregierungen | 4.17 |
| Energie- & Wasserversorgung | 3.53 |
| Nahrungsmittel & Softdrinks | 2.29 |
| Tabak & alkoholische Getränke | 1.84 |
| Detailhandel, Warenhäuser | 1.59 |
| Chemie | 1.39 |
| Pharmazeutik, Kosmetik & medizinische Produkte | 1.18 |
| Telekommunikation | 1.04 |
| Kantone, Bundesstaaten | 1.03 |
| Diverse Handelsfirmen | 0.66 |
| Versicherungen | 0.47 |
| Gastgewerbe & Freizeit | 0.18 |
| **Total** | **98.03** |

## Nettovermögensaufstellung

| | | USD |
|---|---|---|
| **Aktiva** | | **30.9.2016** |
| Wertpapierbestand, Einstandswert | 100 765 591.92 | |
| Wertpapierbestand, nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) | 5 723 672.61 | |
| Total Wertpapierbestand (Erläuterung 1) | | 106 489 264.53 |
| Bankguthaben, Sicht- und Fristgelder | | 1 785 237.02 |
| Andere liquide Mittel (Margins) | | 105 673.68 |
| Forderungen aus Zeichnungen | | 12 230.34 |
| Zinsforderungen aus Wertpapieren | | 915 898.07 |
| Nicht realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten (Erläuterung 1) | | -33 499.78 |
| **Total Aktiva** | | **109 274 803.86** |
| | | |
| **Passiva** | | |
| Verbindlichkeiten aus Swaps | | -19 805.56 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen (Erläuterung 1) | | -269 972.68 |
| Verbindlichkeiten aus Rücknahmen | | -305 101.36 |
| Rückstellungen für pauschale Verwaltungskommission (Erläuterung 2) | -38 770.54 | |
| Rückstellungen für Abonnementsabgabe (Erläuterung 3) | -13 141.08 | |
| Rückstellungen für sonstige Kommissionen und Gebühren (Erläuterung 2) | -1 586.87 | |
| Total Rückstellungen für Aufwendungen | | -53 498.49 |
| **Total Passiva** | | **-648 378.09** |
| | | |
| **Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode** | | **108 626 425.77** |

## Ertrags- und Aufwandsrechnung

| | USD |
|---|---|
| **Erträge** | **1.4.2016-30.9.2016** |
| Zinsertrag auf liquide Mittel | 446.30 |
| Zinsen auf Wertpapiere | 1 770 302.37 |
| Erträge aus Securities Lending (Erläuterung 11) | 24 926.37 |
| Sonstige Erträge | 23 173.17 |
| **Total Erträge** | **1 818 848.21** |
| | |
| **Aufwendungen** | |
| Kosten aus Securities Lending (Erläuterung 11) | -9 970.55 |
| Pauschale Verwaltungskommission (Erläuterung 2) | -500 504.56 |
| Abonnementsabgabe (Erläuterung 3) | -27 664.64 |
| Sonstige Kommissionen und Gebühren (Erläuterung 2) | -7 660.11 |
| **Total Aufwendungen** | **-545 799.86** |
| | |
| **Nettoerträge (-verluste) aus Anlagen** | **1 273 048.35** |
| | |
| **Realisierte Gewinne (Verluste) (Erläuterung 1)** | |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus marktbewerteten Wertpapieren ausser Optionen | 997 442.14 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Optionen | 19 294.33 |
| Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten | 28 671.15 |
| Realisierter Währungsgewinn (-verlust) | 24.63 |
| **Total der realisierten Gewinne (Verluste)** | **1 045 432.25** |
| | |
| **Realisierter Nettogewinn (-verlust) der Berichtsperiode** | **2 318 480.60** |
| | |
| **Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung) (Erläuterung 1)** | |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) marktbewerteter Wertpapiere ausser Optionen | -34 656.39 |
| Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) von Finanzterminkontrakten | -46 718.64 |
| **Total der Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung)** | **-81 375.03** |
| | |
| **Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens infolge Geschäftstätigkeit** | **2 237 105.57** |



Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil des Berichtes.

## Veränderungen des Nettovermögens

| | USD |
|---|---|
| | **1.4.2016-30.9.2016** |
| Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode | 120 827 476.31 |
| Zeichnungen | 16 408 331.65 |
| Rücknahmen | -30 378 101.77 |
| Total Mittelzufluss (-abfluss) | -13 969 770.12 |
| Ausbezahlte Dividende | -468 385.99 |
| Nettoerträge (-verluste) aus Anlagen | 1 273 048.35 |
| Total der realisierten Gewinne (Verluste) | 1 045 432.25 |
| Total der Veränderungen der nicht realisierten Werterhöhung (-minderung) | -81 375.03 |
| Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens infolge Geschäftstätigkeit | 2 237 105.57 |
| **Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode** | **108 626 425.77** |

## Entwicklung der Anteile im Umlauf

| | **1.4.2016-30.9.2016** |
|---|---|
| **Klasse** | **F-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 28 565.6510 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 1 276.4320 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -16 080.7070 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **13 761.3760** |
| **Klasse** | **P-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 289 617.0560 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 48 098.2460 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -75 333.8720 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **262 381.4300** |
| **Klasse** | **P-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 196 295.6170 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 1 110.9350 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -13 652.6320 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **183 753.9200** |
| **Klasse** | **Q-acc** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 17 148.2310 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 8 293.0300 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -4 227.3050 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **21 213.9560** |
| **Klasse** | **Q-dist** |
| Anzahl der Anteile im Umlauf zu Beginn der Berichtsperiode | 5 363.4070 |
| Anzahl der ausgegebenen Anteile | 1 800.7600 |
| Anzahl der zurückgegebenen Anteile | -412.0000 |
| **Anzahl der Anteile im Umlauf am Ende der Berichtsperiode** | **6 752.1670** |

## Jährliche Ausschüttung

| UBS (Lux) Bond Fund | Ex-Date | Pay-Date | Währung | Betrag pro Anteil |
|---|---|---|---|---|
| – USD P-dist | 1.6.2016 | 6.6.2016 | USD | 2.44 |
| – USD Q-dist | 1.6.2016 | 6.6.2016 | USD | 0.92 |

# Aufstellung der Wertpapierbestände und anderer Nettovermögenswerte per 30. September 2016

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in USD NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|

## Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden

### Notes, fester Zins

**USD**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| USD | ACTAVIS FUNDING SCS 3.80000% 15-15.03.25 | 700 000.00 | 740 847.80 | 0.68 |
| USD | ALPHABET INC 3.37500% 16-25.02.24 | 800 000.00 | 875 950.40 | 0.81 |
| USD | APPLE INC 2.40000% 13-03.05.23 | 750 000.00 | 763 608.75 | 0.70 |
| USD | APPLE INC 3.25000% 16-23.02.26 | 700 000.00 | 744 035.60 | 0.69 |
| USD | APPLE INC 3.45000% 14-06.05.24 | 1 000 000.00 | 1 082 225.00 | 1.00 |
| USD | APPLE INC 3.85000% 13-04.05.43 | 850 000.00 | 868 691.50 | 0.80 |
| USD | ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.87500% 11-23.10.18 | 1 200 000.00 | 1 222 617.60 | 1.13 |
| USD | CHILE, REPUBLIC OF 3.25000% 11-14.09.21 | 1 000 000.00 | 1 075 000.00 | 0.99 |
| USD | CISCO SYSTEMS INC 1.65000% 15-15.06.18 | 700 000.00 | 705 746.30 | 0.65 |
| USD | CISCO SYSTEMS INC 5.50000% 09-15.01.40 | 200 000.00 | 259 066.60 | 0.24 |
| USD | CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 4.37500% 12-15.06.22 | 1 500 000.00 | 1 663 875.00 | 1.53 |
| USD | ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S 6.50000% 09-26.01.19 | 1 100 000.00 | 1 219 076.10 | 1.12 |
| USD | ENGIE SA-REG-S 1.62500% 12-10.10.17 | 1 500 000.00 | 1 503 183.00 | 1.38 |
| USD | EXXON MOBIL CORP 3.17600% 14-15.03.24 | 1 500 000.00 | 1 596 267.00 | 1.47 |
| USD | FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.20000% 15-15.01.21 | 1 000 000.00 | 1 026 621.00 | 0.94 |
| USD | FREDDIE MAC 6.25000% 02-15.07.32 | 1 320 000.00 | 1 993 631.64 | 1.84 |
| USD | FREDDIE MAC 6.75000% 00-15.03.31 | 1 500 000.00 | 2 317 896.00 | 2.13 |
| USD | GE CAPITAL INTL FUNDING CO 4.41800% 16-15.11.35 | 1 414 000.00 | 1 587 024.11 | 1.46 |
| USD | GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 2.40000% 16-09.05.19 | 950 000.00 | 955 356.10 | 0.88 |
| USD | HSBC HOLDINGS PLC 3.90000% 16-25.05.26 | 550 000.00 | 569 813.75 | 0.52 |
| USD | HSBC USA INC 2.37500% 14-13.11.19 | 1 050 000.00 | 1 062 903.45 | 0.98 |
| USD | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 1.87500% 12-01.08.22 | 2 500 000.00 | 2 497 187.50 | 2.30 |
| USD | JOHNSON & JOHNSON 2.05000% 16-01.03.23 | 750 000.00 | 765 079.50 | 0.70 |
| USD | JPMORGAN CHASE & CO 3.90000% 15-15.07.25 | 820 000.00 | 884 220.76 | 0.81 |
| USD | KOREA GAS CORP-REG-S 2.25000% 12-25.07.17 | 1 100 000.00 | 1 108 129.00 | 1.02 |
| USD | KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.62500% 12-25.01.22 | 1 000 000.00 | 1 058 438.00 | 0.97 |
| USD | LLOYDS BANK PLC-REG-S 5.80000% 10-13.01.20 | 650 000.00 | 726 209.90 | 0.67 |
| USD | MICROSOFT CORP 4.00000% 15-12.02.55 | 600 000.00 | 613 965.60 | 0.57 |
| USD | MICROSOFT CORP 4.45000% 15-03.11.45 | 380 000.00 | 432 023.90 | 0.40 |
| USD | MITSUBISHI CORP-REG-S 2.87500% 13-18.07.18 | 700 000.00 | 716 569.00 | 0.66 |
| USD | ORACLE CORP 4.37500% 15-15.05.55 | 1 000 000.00 | 1 062 269.00 | 0.98 |
| USD | QATAR, STATE OF-REG-S 5.25000% 09-20.01.20 | 1 500 000.00 | 1 655 625.00 | 1.52 |
| USD | QNB FINANCE LTD-REG-S 2.75000% 13-31.10.18 | 1 250 000.00 | 1 266 025.00 | 1.17 |
| USD | ROCHE HOLDINGS INC-REG-S 2.62500% 16-15.05.26 | 300 000.00 | 308 099.70 | 0.28 |
| USD | ROYAL BANK OF SCOTLAND PLC 6.40000% 09-21.10.19 | 500 000.00 | 552 605.00 | 0.51 |
| USD | SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.25000% 12-06.01.23 | 250 000.00 | 249 297.00 | 0.23 |
| USD | STATOIL ASA 5.25000% 09-15.04.19 | 1 500 000.00 | 1 642 122.00 | 1.51 |
| USD | VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.62500% 16-15.08.26 | 700 000.00 | 687 029.00 | 0.63 |
| USD | WAL-MART STORES INC 6.20000% 08-15.04.38 | 1 200 000.00 | 1 723 095.60 | 1.59 |
| **Total USD** | | | **41 781 427.16** | **38.46** |
| **Total Notes, fester Zins** | | | **41 781 427.16** | **38.46** |

### Medium-Term Notes, fester Zins

**USD**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| USD | ADCB FINANCE CAYMAN LTD-REG-S 2.50000% 13-06.03.18 | 700 000.00 | 704 410.00 | 0.65 |
| USD | AIA GROUP LTD-REG-S 3.20000% 15-11.03.25 | 500 000.00 | 512 560.00 | 0.47 |
| USD | ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.12500% 14-24.11.21 | 1 300 000.00 | 1 343 329.00 | 1.24 |
| USD | BELGIUM, KINGDOM OF-REG-S 2.87500% 14-18.09.24 | 1 300 000.00 | 1 398 215.00 | 1.29 |
| USD | BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 1.62500% 12-17.08.17 | 1 000 000.00 | 1 001 630.00 | 0.92 |
| USD | GENERAL ELECTRIC CO 6.75000% 02-15.03.32 | 1 059 000.00 | 1 488 269.88 | 1.37 |
| USD | MORGAN STANLEY 6.62500% 08-01.04.18 | 1 500 000.00 | 1 607 220.00 | 1.48 |
| USD | NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 2.12500% 14-14.01.20 | 800 000.00 | 817 544.00 | 0.75 |
| **Total USD** | | | **8 873 177.88** | **8.17** |
| **Total Medium-Term Notes, fester Zins** | | | **8 873 177.88** | **8.17** |

### Medium-Term Notes, variabler Zins

**USD**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| USD | AUSTRALIA & NZ BANKING GRP-REG-S-SUB 3.450%/VAR 12-08.08.22 | 600 000.00 | 607 464.00 | 0.56 |
| **Total USD** | | | **607 464.00** | **0.56** |
| **Total Medium-Term Notes, variabler Zins** | | | **607 464.00** | **0.56** |

### Anleihen, fester Zins

**USD**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| USD | AFRICAN DEVELOPMENT BANK 7.37500% 93-06.04.23 | 1 400 000.00 | 1 871 324.00 | 1.72 |
| USD | BANK NEDERLANDSE GEMEENTEN NV-REG-S 2.62500% 14-28.04.21 | 1 650 000.00 | 1 731 757.50 | 1.59 |
| USD | CNOOC FINANCE 2013 LTD 1.75000% 13-09.05.18 | 450 000.00 | 450 533.70 | 0.42 |
| USD | EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.12500% 14-15.10.21 | 1 600 000.00 | 1 651 518.40 | 1.52 |
| USD | EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.87500% 12-15.10.19 | 2 300 000.00 | 2 346 782.00 | 2.16 |
| USD | EXPORT DEVELOPMENT CANADA 1.50000% 13-03.10.18 | 800 000.00 | 808 637.60 | 0.75 |
| USD | FANNIE MAE 2.62500% 14-06.09.24 | 400 000.00 | 428 210.40 | 0.40 |
| USD | INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 2.12500% 13-09.11.20 | 2 000 000.00 | 2 068 188.00 | 1.90 |
| USD | INTER-AMRICAN DEVELPMENT BANK 1.37500% 13-15.07.20 | 1 600 000.00 | 1 608 257.60 | 1.48 |
| USD | INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 7.62500% 93-19.01.23 | 1 350 000.00 | 1 843 041.60 | 1.70 |
| USD | INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 2.50000% 14-25.11.24 | 650 000.00 | 686 133.50 | 0.63 |
| USD | JOHNSON & JOHNSON 2.45000% 14-05.12.21 | 200 000.00 | 209 981.00 | 0.19 |
| USD | KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 4.87500% 09-17.06.19 | 4 750 000.00 | 5 227 489.00 | 4.81 |
| USD | LINDE AG 1.50000% 13-18.04.18 | 1 500 000.00 | 1 505 775.00 | 1.39 |
| USD | NOVARTIS CAPITAL CORP 4.40000% 14-06.05.44 | 900 000.00 | 1 062 991.80 | 0.98 |
| USD | NTT FINANCE CORP 1.50000% 12-25.07.17 | 1 400 000.00 | 1 402 800.00 | 1.29 |

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in USD NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|
| USD | ROYAL BANK OF CANADA 2.20000% 14-23.09.19 | 1 650 000.00 | 1 682 410.95 | 1.55 |
| USD | UBS GROUP FUNDING JERSEY LTD-REG-S 2.95000% 15-24.09.20 | 650 000.00 | 665 874.95 | 0.61 |
| USD | VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.60000% 11-01.04.21 | 400 000.00 | 445 072.40 | 0.41 |
| **Total USD** | | | **27 696 779.40** | **25.50** |
| **Total Anleihen, fester Zins** | | | **27 696 779.40** | **25.50** |
| **Treasury-Notes, fester Zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | AMERICA, UNITED STATES OF 3.00000% 14-15.11.44 | 350 000.00 | 399 068.25 | 0.37 |
| **Total USD** | | | **399 068.25** | **0.37** |
| **Total Treasury-Notes, fester Zins** | | | **399 068.25** | **0.37** |
| **Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden** | | | **79 357 916.69** | **73.06** |

## Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Notes, fester Zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | ALTRIA GROUP INC 2.85000% 12-09.08.22 | 1 100 000.00 | 1 148 555.10 | 1.06 |
| USD | AMERICAN HONDA FINANCE CORP-REG-S 1.60000% 13-16.02.18 | 500 000.00 | 502 585.00 | 0.46 |
| USD | CHEVRON CORP 2.35500% 12-05.12.22 | 1 600 000.00 | 1 628 971.20 | 1.50 |
| USD | CISCO SYSTEMS INC 3.00000% 15-15.06.22 | 700 000.00 | 749 634.20 | 0.69 |
| USD | DANONE-REG-S 3.00000% 12-15.06.22 | 300 000.00 | 312 055.50 | 0.29 |
| USD | FANNIE MAE 7.12500% 00-15.01.30 | 1 850 000.00 | 2 891 868.20 | 2.66 |
| USD | GENERAL ELECTRIC CO 4.12500% 12-09.10.42 | 450 000.00 | 492 472.80 | 0.45 |
| USD | HEINEKEN NV-REG-S 1.40000% 12-01.10.17 | 850 000.00 | 851 227.40 | 0.78 |
| USD | IMPERIAL TOBACCO FINANCE PLC-REG-S 2.05000% 13-11.02.18 | 1 150 000.00 | 1 156 877.00 | 1.07 |
| USD | KRAFT HEINZ FOODS CO 3.50000% 12-06.06.22 | 1 000 000.00 | 1 062 506.00 | 0.98 |
| USD | MET LIFE GLOBAL FUNDING I-REG-S 1.50000% 13-10.01.18 | 600 000.00 | 601 647.00 | 0.55 |
| USD | MICROSOFT CORP 3.62500% 13-15.12.23 | 850 000.00 | 933 264.30 | 0.86 |
| USD | MICROSOFT CORP 4.50000% 10-01.10.40 | 570 000.00 | 653 095.74 | 0.60 |
| USD | MONDELEZ INTL 2.25000% 14-01.02.19 | 1 100 000.00 | 1 118 906.80 | 1.03 |
| USD | SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 1.12500% 12-21.08.17 | 350 000.00 | 350 108.50 | 0.32 |
| USD | SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOP-REG-S 4.37500% 14-10.04.24 | 950 000.00 | 1 051 087.60 | 0.97 |
| USD | SVENSKA HANDELSBANKEN AB 2.50000% 13-25.01.19 | 750 000.00 | 766 864.50 | 0.71 |
| USD | TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 2.75000% 14-19.06.21 | 550 000.00 | 574 448.05 | 0.53 |
| **Total USD** | | | **16 846 174.89** | **15.51** |
| **Total Notes, fester Zins** | | | **16 846 174.89** | **15.51** |
| **Medium-Term Notes, fester Zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | BANK OF AMERICA CORP 2.00000% 13-11.01.18 | 1 600 000.00 | 1 607 366.40 | 1.48 |
| USD | MCDONALD'S CORP 1.87500% 12-29.05.19 | 200 000.00 | 202 130.80 | 0.18 |
| USD | NORDEA BANK AB-REG-S 1.87500% 15-17.09.18 | 600 000.00 | 604 147.20 | 0.56 |
| USD | ROYAL BANK OF CANADA 2.20000% 13-27.07.18 | 1 000 000.00 | 1 014 072.00 | 0.93 |
| USD | SOCIETE GENERALE 2.75000% 12-12.10.17 | 750 000.00 | 759 337.50 | 0.70 |
| **Total USD** | | | **4 187 053.90** | **3.85** |
| **Total Medium-Term Notes, fester Zins** | | | **4 187 053.90** | **3.85** |
| **Anleihen, fester Zins** | | | | |
| **USD** | | | | |
| USD | AUSTRALIA & NZ BANKING GRP-REG-S 2.40000% 11-23.11.16 | 1 500 000.00 | 1 502 824.95 | 1.38 |
| USD | BNP PARIBAS 5.00000% 11-15.01.21 | 1 250 000.00 | 1 398 615.00 | 1.29 |
| USD | FANNIE MAE 6.25000% 99-15.05.29 | 300 000.00 | 433 146.00 | 0.40 |
| USD | ONTARIO, PROVINCE OF 2.00000% 13-27.09.18 | 1 100 000.00 | 1 118 877.10 | 1.03 |
| USD | THE EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 2.87500% 13-17.09.18 | 1 600 000.00 | 1 644 656.00 | 1.51 |
| **Total USD** | | | **6 098 119.05** | **5.61** |
| **Total Anleihen, fester Zins** | | | **6 098 119.05** | **5.61** |
| **Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | **27 131 347.84** | **24.97** |
| **Total des Wertpapierbestandes** | | | **106 489 264.53** | **98.03** |

| | Bezeichnung | Anzahl/ Nominal | Bewertung in USD NR Kursgewinn (-verlust) auf Futures/ Devisentermin-kontrakten/ Swaps (Erl. 1) | in % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|

## Derivative Instrumente

### Derivative Instrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden

**Financial Futures auf Anleihen**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| USD | US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 30.12.16 | 35.00 | 9 297.05 | 0.01 |
| USD | US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.12.16 | -55.00 | -10 312.50 | -0.01 |
| USD | US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 20.12.16 | 9.00 | -32 484.33 | -0.03 |
| **Total Financial Futures auf Anleihen** | | | **-33 499.78** | **-0.03** |
| **Total Derivative Instrumente, die an einer offiziellen Börse gehandelt werden** | | | **-33 499.78** | **-0.03** |
| **Total Derivative Instrumente** | | | **-33 499.78** | **-0.03** |
| **Bankguthaben, Sicht- und Fristgelder und andere liquide Mittel** | | | **1 890 910.70** | **1.74** |
| **Andere Aktiva und Passiva** | | | **279 750.32** | **0.26** |
| **Total des Nettovermögens** | | | **108 626 425.77** | **100.00** |

# Erläuterungen zum Halbjahresbericht

**Erläuterung 1 – Wichtigste Grundsätze der Rechnungslegung**

Der Rechnungsabschluss wurde gemäss den allgemein anerkannten Bilanzierungsgrundsätzen für Anlagefonds in Luxemburg erstellt. Die wichtigsten Bilanzierungsgrundsätze lassen sich wie folgt zusammenfassen:

*a) Berechnung des Nettoinventarwertes*
Der Nettoinventarwert (Nettovermögenswert) sowie Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil eines jeden Subfonds bzw. einer jeden Anteilsklasse werden in den jeweiligen Rechnungswährungen, in welchen die unterschiedlichen Subfonds bzw. Anteilsklassen ausgewiesen sind, ausgedrückt und an jedem Geschäftstag ermittelt, indem das gesamte Nettovermögen pro Subfonds, welches jeder Anteilsklasse zuzurechnen ist, durch die Anzahl der sich im Umlauf befindlichen Anteile der jeweiligen Anteilsklasse dieses Subfonds geteilt wird.

Unter «Geschäftstag» versteht man in diesem Zusammenhang die üblichen Bankgeschäftstage (d.h. jeden Tag, an dem die Banken während der normalen Geschäftsstunden geöffnet sind) in Luxemburg, mit Ausnahme von einzelnen, nicht gesetzlichen Ruhetagen in Luxemburg, sowie Tage, an welchen die Börsen der Hauptanlageländer des jeweiligen Subfonds geschlossen sind, bzw. 50% oder mehr der Anlagen des Subfonds nicht adäquat bewertet werden können.

Der Prozentsatz des Nettoinventarwertes, welcher den jeweiligen Anteilsklassen eines Subfonds zuzurechnen ist, wird, unter Berücksichtigung der der jeweiligen Anteilsklasse belasteten Kommissionen, durch das Verhältnis der im Umlauf befindlichen Anteile jeder Anteilsklasse gegenüber der Gesamtheit der ausgegebenen Anteile des Subfonds bestimmt und ändert sich jedes Mal, wenn eine Ausgabe oder Rücknahme von Anteilen stattfindet.

Falls an einem Handelstag die Summe der Zeichnungen bzw. Rücknahmen aller Anteilsklassen eines Subfonds zu einem Nettokapitalzufluss bzw. -abfluss führt, kann der Nettoinventarwert des betreffenden Subfonds erhöht bzw. reduziert werden. Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Nettoinventarwertes. Berücksichtigt werden können sowohl die geschätzten Transaktionskosten und Steuerlasten, die dem Subfonds entstehen können, als auch die geschätzte Geld-/Briefspanne der Vermögenswerte, in die der Fonds anlegt. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Nettoinventarwerts, wenn die Nettobewegungen zu einem Anstieg der Anzahl der Anteile des betroffenen Subfonds führen. Sie resultiert in einer Verminderung des Nettoinventarwerts, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang der Anzahl der Anteile bewirken. Der Verwaltungsrat kann für jeden Subfonds einen Schwellenwert festsetzen. Dieser kann aus der Nettobewegung an einem Handelstag im Verhältnis zum Nettofondsvermögen oder einem absoluten Betrag in der Währung des jeweiligen Subfonds bestehen. Eine Anpassung des Nettoinventarwerts würde somit erst erfolgen, wenn dieser Schwellenwert an einem Handelstag überschritten wird.

Diese Anpassung wird zu Gunsten des Subfonds erhoben und in der Ertrags- und Aufwandsrechnung in der Position «Sonstige Erträge» ausgewiesen.

*b) Bewertungsgrundsätze*
– Als Wert von Barmitteln – sei es in Form von Barbeständen oder Bankguthaben sowie von Wechseln und Sichtpapieren und Forderungen, Vorauszahlungen auf Kosten, Bardividenden und erklärten oder aufgelaufenen Zinsen, die noch nicht erhalten wurden – gilt deren voller Wert, es sei denn es ist unwahrscheinlich, dass dieser vollständig gezahlt oder erhalten wird, in welchem Fall ihr Wert dadurch bestimmt wird, dass ein angemessen erscheinender Abzug berücksichtigt wird, um ihren wirklichen Wert darzustellen.
– Wertpapiere, Derivate und andere Anlagen, welche an einer Börse notiert sind, werden zu den letztbekannten Marktpreisen bewertet. Falls diese Wertpapiere, Derivate oder andere Anlagen an mehreren Börsen notiert sind, ist der letzt verfügbare Kurs an jener Börse massgebend, die den Hauptmarkt für diese Anlagen darstellt.
  Bei Wertpapieren, Derivaten und anderen Anlagen, bei welchen der Handel an einer Börse geringfügig ist und für welche ein Zweitmarkt zwischen Wertpapierhändlern mit marktkonformer Preisbildung besteht, kann die Verwaltungsgesellschaft die Bewertung dieser Wertpapiere, Derivate und anderen Anlagen auf Grund dieser Preise vornehmen. Wertpapiere, Derivate und andere Anlagen, die nicht an einer Börse notiert sind, die aber an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden, der anerkannt, für das Publikum offen und dessen Funktionsweise ordnungsgemäss ist, werden zum letzt verfügbaren Kurs auf diesem Markt bewertet.
– Bei Wertpapieren und anderen Anlagen, welche nicht an einer Börse notiert sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden, und für die kein adäquater Preis erhältlich ist, wird die Verwaltungsgesellschaft gemäss anderen, von ihr nach Treu und

Glauben zu bestimmenden Grundsätzen auf der Basis der voraussichtlich möglichen Verkaufspreise bewerten.
– Die Bewertung von Derivaten, die nicht an einer Börse notiert sind (OTC-Derivate), erfolgt anhand unabhängiger Preisquellen. Sollte für ein Derivat nur eine unabhängige Preisquelle vorhanden sein, wird die Plausibilität dieses Bewertungskurses mittels Berechnungsmodellen, die von der Verwaltungsgesellschaft des Fonds anerkannt sind, auf der Grundlage des Verkehrswertes des Basiswertes, von dem das Derivat abgeleitet ist, nachvollzogen.
– Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) und/oder Organismen für gemeinsame Anlagen (OGA) werden zu ihrem letztbekannten Nettoinventarwert bewertet.
– Die Bewertung von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, erfolgt auf Basis der jeweils relevanten Kurven. Die auf den Kurven basierende Bewertung bezieht sich auf die Komponenten Zinssatz und Credit-Spread. Dabei werden folgende Grundsätze angewandt: Für jedes Geldmarktinstrument werden die der Restlaufzeit nächsten Zinssätze interpoliert. Der dadurch ermittelte Zinssatz wird unter Zuzug eines Credit-Spreads, welcher die Bonität des zugrundeliegenden Schuldners wiedergibt, in einen Marktkurs konvertiert. Dieser Credit-Spread wird bei signifikanter Änderung der Bonität des Schuldners angepasst.
Die Zinserträge der einzelnen Subfonds zwischen dem betreffenden Auftragstag und dem betreffenden Valutatag in die Bewertung des Vermögens des jeweiligen Subfonds einbezogen. Damit beinhaltet der Inventarwert je Aktie am jeweiligen Bewertungstag projizierte Zinserträge.
– Wertpapiere, Geldmarktinstrumente, Derivate und andere Anlagen, die auf eine andere Währung als die Rechnungswährung des entsprechenden Subfonds lauten und welche nicht durch Devisentransaktionen abgesichert sind, werden zum Währungsmittelkurs zwischen Kauf- und Verkaufspreis, der in Luxemburg oder, falls nicht erhältlich, auf dem für diese Währung repräsentativsten Markt bekannt ist, bewertet.
– Fest- und Treuhandgelder werden zu ihrem Nennwert zuzüglich aufgelaufener Zinsen bewertet.
– Der Wert der Tauschgeschäfte wird von einem externen Anbieter berechnet, und eine zweite unabhängige Berechnung wird durch einen anderen externen Anbieter zur Verfügung gestellt. Die Berechnung basiert auf dem aktuellen Wert (Net Present Value) aller Cash Flows, sowohl In- als auch Outflows. In einigen spezifischen Fällen können interne Berechnungen - basierend auf von Bloomberg zur Verfügung gestellten Modellen und Marktdaten – und/oder Broker Statement Bewertungen verwendet werden. Die Berechnungsmethoden hängen von dem jeweiligen Wertpapier ab und werden gemäss der Global Valuation Policy festgelegt.

Erweist sich auf Grund besonderer Umstände eine Bewertung nach Massgabe der vorstehenden Regeln als undurchführbar oder ungenau, ist die Verwaltungsgesellschaft berechtigt, nach Treu und Glauben andere allgemein anerkannte und überprüfbare Bewertungskriterien anzuwenden, um eine angemessene Bewertung des Nettovermögens zu erzielen.

Bei ausserordentlichen Umständen können im Verlaufe des Tages weitere Bewertungen vorgenommen werden, die für die anschliessende Ausgabe und Rücknahme der Anteile massgebend sind.

*c) Bewertung der Devisentermingeschäfte*
Die nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) der ausstehenden Devisentermingeschäfte wird am Bewertungstag zum Terminwechselkurs berechnet und gebucht.

*d) Bewertung der Finanzterminkontrakte*
Finanzterminkontrakte werden mit dem zuletzt verfügbaren Preis des Bewertungstages bewertet. Realisierte Gewinne und Verluste und die Veränderungen der nicht realisierten Gewinne und Verluste sind in der Ertrags- und Aufwandsrechnung gebucht. Die realisierten Gewinne und Verluste werden dabei nach der FIFO-Methode ermittelt, d.h. zuerst erworbene Kontrakte gelten als zuerst verkauft.

*e) Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapierverkäufen*
Die aus den Verkäufen von Wertpapieren realisierten Gewinne oder Verluste werden auf der Basis des durchschnittlichen Einstandspreises der verkauften Wertpapiere berechnet.

*f) Umrechnung der ausländischen Währungen*
Die Bankguthaben, die anderen Nettovermögenswerte sowie die Bewertung der Wertpapiere im Bestand, die auf andere Währungen als die Referenzwährung der verschiedenen Subfonds lauten, werden zu den «Mid Closing Spot Rates» des Bewertungstages umgerechnet. Die Erträge und Kosten in anderen Währungen als die der verschiedenen Subfonds werden zu den «Mid Closing Spot Rates» des Abrechnungstages umgerechnet. Währungsgewinne und -verluste werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung berücksichtigt.

Der Einstandswert der Wertpapiere, der auf andere Währungen als die Referenzwährung der verschiedenen Subfonds lautet, wird zu den am Tag des Erwerbs gültigen «Mid Closing Spot Rate» umgerechnet.

*g) Buchung der Transaktionen im Wertpapierbestand*
Die Transaktionen im Wertpapierbestand werden an dem auf den Transaktionstag folgenden Bankgeschäftstag gebucht.

*h) Swaps*
Der Fonds kann Zinsswaps und Zinssicherungsvereinbarungen (Forward Rate Agreements auf Zinssätze und Credit Default Swaps) sowie Optionen auf Zinsswaps (Swaptions) mit erstklassigen Finanzinstituten, die auf diese Geschäftsart spezialisiert sind, im Rahmen von freihändigen Geschäften abschliessen.

Veränderungen in nicht realisierten Gewinnen bzw. Verlusten werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung unter «Nicht realisierte Werterhöhung (-minderung) von Swaps» ausgewiesen.

Gewinne bzw. Verluste auf Swaps bei Glattstellung oder Fälligkeit werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung als «Realisierter Kursgewinn (-verlust) aus Swaps» verbucht.

*i) Konsolidierter Halbjahresabschluss*
Der konsolidierte Halbjahresabschluss ist in EUR erstellt. Die verschiedenen konsolidierten Nettovermögenswerte und die konsolidierte Aufstellung der Ertrags- und Aufwandsrechnung zum 30. September 2016 stellen die Summe der entsprechenden Werte jedes Subfonds umgerechnet in EUR zum Wechselkurs am Abschlusstag dar.

Folgende Wechselkurse wurden für die Umrechnung des konsolidierten Halbjahresabschlusses per 30. September 2016 verwendet:

| **Wechselkurse** | | | | |
|---|---|---|---|---|
| EUR | 1 | = | AUD | 1.468540 |
| EUR | 1 | = | CAD | 1.476954 |
| EUR | 1 | = | CHF | 1.089412 |
| EUR | 1 | = | GBP | 0.865127 |
| EUR | 1 | = | USD | 1.123800 |

Für die liquidierten oder fusionierten Subfonds wurden für die Konsolidierung die Wechselkurse per Liquidations oder Fusionsdatum verwendet.

*j) «Mortgage-Backed Securities»*
Der Fonds kann, in Übereinstimmung mit seiner Anlagepolitik, in «Mortgage-Backed Securities» investieren. Ein «Mortgage-Backed Security» ist eine Beteiligung an einem Zusammenschluss von in Wertpapieren verbrieften privaten Hypothekarkrediten. Kapitalrückzahlungen und Zinszahlungen der zugrundeliegenden Hypotheken gehen an den Inhaber des «Mortgage-Backed Security», abzüglich der grundlegenden Kosten des Wertpapieres. Die Kapital- und Zinszahlungen können durch parastaatliche Einrichtungen der Vereinigten Staaten garantiert werden. Ein Gewinn oder Verlust wird auf jedem «Paydown» berechnet, in Verbindung mit jeder Kapitalrückzahlung. Dieser Gewinn oder Verlust wird als realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapierverkäufen in der Ertrags- und Aufwandsrechnung aufgeführt. Zusätzlich können vor Ablauf zurückgezahlte Hypotheken die Laufzeit des Wertpapieres verkürzen und somit die erwartete Rendite des Fonds beeinflussen.

Für «Mortgage-Backed Securities» gilt folgende Regelung: Ist der auf den Nennbetrag des Wertpapiers anzuwendende Faktor am Bewertungstag grösser eins, wird der im Rechnungsabschluss ausgewiesene Nennbetrag um diesen Faktor bereinigt. Andernfalls widerspiegelt der ausgewiesene Nennbetrag einen Faktor von eins.

*k) Forderungen aus Wertpapierverkäufen, Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen*
Der Posten «Forderungen aus Wertpapierverkäufen» kann ebenfalls Forderungen aus Devisengeschäften enthalten. Der Posten «Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen» kann ebenfalls Verbindlichkeiten aus Devisengeschäften enthalten.

*l) Einkommensbestätigung*
Dividenden (nach Quellensteuer) gelten von dem Tag an als Einkommen, an dem die entsprechenden Wertpapiere erstmals «ex Dividende» notiert sind. Der Zinsertrag läuft täglich auf.

*m) To Be Announced («TBA») Mortgage Backed Securities*
TBA Positionen beziehen sich auf die allgemeine Handelspraxis auf dem «Mortgage-Backed Securities» Markt, auf dem ein Wertpapier aus einem «Mortgage-Pool» (Ginnie Mae, Fannie Mae oder Freddie Mac) zu einem Festpreis an einem zukünftigen Datum gekauft wird. Zum Zeitpunkt des Ankaufs ist die exakte Zusammensetzung des Wertpapieres noch nicht bekannt, jedoch sind die wesentlichen Charakteristika bereits festgelegt. Der Preis wird ebenfalls zu diesem Zeitpunkt festgelegt, obschon der Nominalwert noch nicht abschliessend bestimmt ist.

Die TBA Positionen sind in der Position «Nicht realisierter Kursgewinn (-verlust) aus TBA Mortgage Backed Securities» beinhaltet. Per 30. September 2016 beträgt der Wert der TBA Positionen für den Subfonds UBS (Lux) Bond Fund – Global (CHF) 12 106 946.97 CHF.

## Erläuterung 2 – Pauschale Verwaltungskommission

Der Fonds zahlt für die verschiedenen Subfonds bzw. der Anteilsklassen eine maximale pauschale Verwaltungskommission, berechnet auf dem durchschnittlichen Nettoinventarwert der Subfonds bzw. der Anteilsklassen, welche in der nachfolgenden Tabelle aufgeführt ist:

UBS (Lux) Bond Fund – AUD
UBS (Lux) Bond Fund – CAD
UBS (Lux) Bond Fund – CHF
UBS (Lux) Bond Fund – EUR
UBS (Lux) Bond Fund – GBP
UBS (Lux) Bond Fund – USD

| | **Maximale Pauschale Verwaltungskommission** |
|---|---|
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «P» | 0.900% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «N» | 1.000%<br>1.600% für den Subfonds UBS (Lux) Bond Fund – EUR[1] |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «K-1» | 0.550% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «K-X» | 0.000% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «F» | 0.340%<br>0.250% für den Subfonds UBS (Lux) Bond Fund – CHF |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «Q» | 0.500% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «I-A1» | 0.460% |

| | Maximale Pauschale Verwaltungskommission |
|---|---|
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «I-A2» | 0.400%<br>0.340% für den Subfonds UBS (Lux) Bond Fund – CHF |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «I-A3» | 0.340%<br>0.250% für den Subfonds UBS (Lux) Bond Fund – CHF |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «I-B» | 0.065% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «I-X» | 0.000%[1] |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «U-X» | 0.000% |

[1] Max. 1.600% / Eff. 1.200%

## UBS (Lux) Bond Fund – Convert Europe (EUR)

| | Maximale Pauschale Verwaltungskommission |
|---|---|
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «P» | 1.800% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «N» | 2.100% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «K-1» | 1.020% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «K-X» | 0.000% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «F» | 0.400% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «Q» | 0.900% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «I-A1» | 0.500% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «I-A2» | 0.460% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «I-A3» | 0.400% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «I-B» | 0.065% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «I-X» | 0.000% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «U-X» | 0.000% |

## UBS (Lux) Bond Fund – Euro High Yield (EUR)

| | Maximale Pauschale Verwaltungskommission |
|---|---|
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «P» | 1.260% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «N» | 1.750% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «K-1» | 0.700% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «K-X» | 0.000% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «F» | 0.520% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «Q» | 0.720% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «I-A1» | 0.620% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «I-A2» | 0.580% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «I-A3» | 0.520% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «I-B» | 0.065% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «I-X» | 0.000% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «U-X» | 0.000% |

## UBS (Lux) Bond Fund – Global (CHF)

| | Maximale Pauschale Verwaltungskommission |
|---|---|
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «P» | 1.140% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «N» | 1.600% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «K-1» | 0.600% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «K-X» | 0.000% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «F» | 0.320% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «Q» | 0.600% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «I-A1» | 0.510% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «I-A2» | 0.380% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «I-A3» | 0.320% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «I-B» | 0.065% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «I-X» | 0.000% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «U-X» | 0.000% |

## UBS (Lux) Bond Fund – Full Cycle Asian Bond (USD)

| | Maximale Pauschale Verwaltungskommission |
|---|---|
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «P» | 1.500% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «N» | 1.750% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «K-1» | 0.900% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «K-X» | 0.000% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «F» | 0.520%[1] |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «Q» | 0.800% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «I-A1» | 0.680% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «I-A2» | 0.620% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «I-A3» | 0.520% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «I-B» | 0.115% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «I-X» | 0.000% |
| Anteilsklassen mit Namensbestandteil «U-X» | 0.000% |

[1] nur für die Anteilsklasse F-acc Max. 0.520% / Eff. 0.370%

Die obengenannten maximalen pauschalen Verwaltungskommissionen werden wie folgt verwendet:

1. Für die Verwaltung, die Administration, das Portfolio Management und ggf. den Vertrieb des Fonds sowie für alle Aufgaben der Verwahrstelle wie die Verwahrung des und Aufsicht über das Fondsvermögen, die Besorgung des Zahlungsverkehrs und die sonstigen im Kapitel «Verwahrstelle und Hauptzahlstelle» des Verkaufsprospektes aufgeführten Aufgaben, wird zulasten des Fonds eine maximale pauschale Verwaltungskommission auf Basis des Nettoinventarwertes des Fonds gemäss nachfolgender Angaben in Rechnung gestellt. Diese wird pro rata temporis bei jeder Berechnung des Nettoinventarwertes dem Fondsvermögen belastet und jeweils monatlich ausbezahlt (maximale pauschale Verwaltungskommission). Die jeweilige maximale pauschale Verwaltungskommission wird erst mit Lancierung der entsprechenden Anteilsklassen belastet. Einen Überblick über die maximale pauschale Verwaltungskommission kann dem Abschnitt «Die Subfonds und deren spezielle Anlagepolitiken» des Verkaufsprospektes entnommen werden.

2. Nicht in der maximalen pauschalen Verwaltungskommission enthalten sind die folgenden Vergütungen und Nebenkosten, welche zusätzlich dem Fondsvermögen belastet werden:
   a) Sämtliche aus der Verwaltung des Fondsvermögens erwachsenden Nebenkosten für den An- und Verkauf der Anlagen (Geld/Brief-Spanne, marktkonforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.). Diese Kosten werden grundsätzlich beim Kauf bzw. Verkauf der betreffenden Anlagen verrechnet. In Abweichung hiervon sind diese Nebenkosten, die durch An- und Verkauf von Anlagen bei der Abwicklung von Ausgabe und Rücknahme von Anteilen anfallen, durch die Anwendung des Swinging Single Pricing gemäss Kapitel «Nettoinventarwert, Ausgabe-, Rücknahme- und Konversionspreis» des Verkaufsprospektes gedeckt;

b) Abgaben an die Aufsichtsbehörde für die Gründung, Änderung, Liquidation und Verschmelzung des Fonds sowie allfällige Gebühren der Aufsichtsbehörden und ggf. der Börsen an welchen die Subfonds notiert sind;
c) Honorare der Prüfgesellschaft für die jährliche Prüfung sowie für Bescheinigungen im Rahmen von Gründungen, Änderungen, Liquidation und Verschmelzungen des Fonds sowie sonstige Honorare, die an die Prüfgesellschaft für ihre Dienstleistungen gezahlt werden, die sie im Rahmen des Fondsbetriebs erbringt und sofern im Rahmen der gesetzlichen Vorschriften erlaubt;
d) Honorare für Rechts- und Steuerberater sowie Notare im Zusammenhang mit Gründungen, Registrierungen in Vertriebsländern, Änderungen, Liquidation und Verschmelzungen des Fonds sowie der allgemeinen Wahrnehmung der Interessen des Fonds und seiner Anleger, sofern dies nicht aufgrund gesetzlicher Vorschriften explizit ausgeschlossen wird;
e) Kosten für die Publikation des Nettoinventarwertes des Fonds sowie sämtliche Kosten für Mitteilungen an die Anleger einschliesslich der Übersetzungskosten;
f) Kosten für rechtliche Dokumente des Fonds (Prospekte, KIID, Jahres- und Halbjahresberichte sowie jegliche anderen rechtlich erforderlichen Dokumente im Domizilland sowie in den Vertriebsländern);
g) Kosten für eine allfällige Eintragung des Fonds bei einer ausländischen Aufsichtsbehörde, namentlich von der ausländischen Aufsichtsbehörde erhobene Kommissionen, Übersetzungskosten sowie die Entschädigung des Vertreters oder der Zahlstelle im Ausland;
h) Kosten im Zusammenhang mit der Ausübung von Stimmrechten oder Gläubigerrechten durch den Fonds, einschliesslich der Honorarkosten für externe Berater;
i) Kosten und Honorare im Zusammenhang mit im Namen des Fonds eingetragenem geistigen Eigentum oder mit Nutzungsrechten des Fonds;
j) Alle Kosten, die durch die Ergreifung ausserordentlicher Schritte zur Wahrung der Interessen der Anleger durch die Verwaltungsgesellschaft, den Portfolio Manager oder die Verwahrstelle verursacht werden;
k) Bei Teilnahme an Sammelklagen im Interesse der Anleger darf die Verwaltungsgesellschaft die daraus entstandenen Kosten Dritter (z.B. Anwalts- und Verwahrstelle kosten) dem Fondsvermögen belasten. Zusätzlich kann die Verwaltungsgesellschaft sämtliche administrativen Aufwände belasten, sofern diese nachweisbar sind und im Rahmen der Offenlegung der TER (Total Expense Ratio) des Fonds ausgewiesen resp. berücksichtigt werden;

3. Die Verwaltungsgesellschaft kann Retrozessionen zur Deckung der Vertriebstätigkeit des Fonds bezahlen.

Aus der Verwaltungskommission werden Vergütungen für den Vertrieb des Fonds an Vertriebsträger und Vermögensverwalter ausgerichtet.

Ausserdem trägt der Fonds alle Steuern, welche auf den Vermögenswerten und dem Einkommen des Fonds erhoben werden, insbesondere die Abgabe der taxe d'abonnement.

Zum Zweck der allgemeinen Vergleichbarkeit mit Vergütungsregelungen verschiedener Fondsanbieter, welche die pauschale Verwaltungskommission nicht kennen, wird der Begriff «maximale Managementkommission» mit 80% der pauschalen Verwaltungskommission gleichgesetzt.

Für die Anteilsklasse «I-B» wird eine Kommission erhoben, welche die Kosten für die Fondsadministration (bestehend aus Kosten der Verwaltungsgesellschaft, Administration und Verwahrstelle) abdeckt. Die Kosten für die Vermögensverwaltung und den Vertrieb werden ausserhalb des Fonds, direkt auf der Ebene eines separaten Vertrages zwischen dem Anleger und UBS Asset Management bzw. einem seiner bevollmächtigten Vertreter, in Rechnung gestellt.

Kosten im Zusammenhang mit den für die Anteilsklassen «I-X», «K-X» und «U-X» zu erbringenden Leistungen für die Vermögensverwaltung und die Fondsadministration (bestehend aus Kosten der Verwaltungsgesellschaft, Administration und Verwahrstelle) sowie den Vertrieb werden über diejenigen Entschädigungen abgegolten, welche der UBS AG aus einem separaten Vertrag mit dem Anleger zustehen.

Sämtliche Kosten, die den einzelnen Subfonds bzw. den einzelnen Anteilsklassen genau zugeordnet werden können, werden diesen in Rechnung gestellt. Falls sich Kosten auf mehrere oder alle Subfonds bzw. Anteilsklassen beziehen, werden diese Kosten den betroffenen Subfonds bzw. Anteilsklassen proportional zu ihren Nettoinventarwerten belastet.

In den Subfonds, die im Rahmen ihrer Anlagepolitik in andere bestehende OGA oder OGAW investieren können, können Gebühren sowohl auf der Ebene des Subfonds als auch auf der Ebene des betreffenden Zielfonds anfallen. Dabei darf die Verwaltungskommission des Zielfonds, in den das Vermögen des Subfonds investiert wird, unter Berücksichtigung von etwaigen Rückvergütungen höchstens 3% betragen.

Bei der Anlage in Anteile von Fonds, die unmittelbar oder mittelbar von der Verwaltungsgesellschaft selbst oder von einer anderen Gesellschaft verwaltet werden, mit der sie durch gemeinsame Verwaltung oder Beherrschung oder durch eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung der Verwaltungsgesellschaft oder durch eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung einer anderen Gesellschaft derselben Unternehmensgruppe verbunden ist,

darf die Beteiligung des Subfonds an dem Zielfonds nicht mit den allfälligen Ausgabe- und Rücknahmekommissionen des Zielfonds belastet werden.

Angaben zu den laufenden Kosten des Fonds können den KIIDs entnommen werden.

## Erläuterung 3 – Abonnementsabgabe

Entsprechend der Gesetzgebung in Luxemburg und den gegenwärtig gültigen Reglements unterliegt der Fonds der luxemburgischen Abonnementsabgabe zum Jahressatz von 0.05%, für institutionelle Anteilsklassen nur eine reduzierte «taxe d'abonnement» in Höhe von 0.01% pro Jahr, zahlbar pro Quartal und berechnet auf das Nettovermögen des Fonds am Ende eines jeden Quartals.

Die Abonnementsabgabe entfällt für den Teil des Nettovermögens, der in Anteilen oder Aktien anderer Organismen für gemeinsame Anlagen angelegt ist, welche bereits der Abonnementsabgabe nach den einschlägigen Bestimmungen des Luxemburger Rechts unterworfen sind.

## Erläuterung 4 – Ausschüttung der Erträge

Gemäss Artikel 10 der Vertragsbedingungen bestimmt die Verwaltungsgesellschaft nach Abschluss der Jahresrechnung, ob und in welchem Umfang die jeweiligen Subfonds Ausschüttungen vornehmen. Ausschüttungen dürfen nicht bewirken, dass das Nettovermögen des Fonds unter das vom Gesetz von 2010 vorgesehene Mindestfondsvermögen fällt. Falls Ausschüttungen vorgenommen werden, erfolgen diese innerhalb von vier Monaten nach Abschluss des Geschäftsjahres.

Die Details zu den Ausschüttungen sind ungeprüft.

Der Verwaltungsrat ist berechtigt, die Auschüttung von Zwischendividenden sowie die Aussetzung der Ausschüttungen zu bestimmen.

Damit die Ausschüttungen dem tatsächlichen Ertragsanspruch entsprechen, wird ein Ertragsausgleich errechnet.

## Erläuterung 5 – Soft commission arrangements

Für die Periode vom 1. April 2016 bis zum 30. September 2016 wurden keine «soft commission arrangements» im Namen von UBS (Lux) Bond Fund getätigt und die «soft commissions» waren gleich null.

## Erläuterung 6 – Eventualverpflichtungen aus Finanzterminkontrakten und Swaps

Die Eventualverpflichtungen aus Finanzterminkontrakten und Swaps per 30. September 2016 sind nachfolgend pro Subfonds mit Währung aufgeführt:

*a) Finanzterminkontrakte*

| UBS (Lux) Bond Fund | Finanztermin-kontrakte auf Anleihen (gekauft) | Finanztermin-kontrakte auf Anleihen (verkauft) |
|---|---|---|
| – AUD | 12 331 462.50 AUD | 13 143 985.52 AUD |
| – EUR | 20 468 687.21 EUR | 49 522 076.33 EUR |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) | 9 929 250.00 USD | - USD |
| – GBP | 3 139 800.00 GBP | - GBP |
| – Global (CHF) | 38 051 190.71 CHF | 42 280 923.27 CHF |
| – USD | 9 301 281.25 USD | 7 211 875.00 USD |

*b) Swaps*

| UBS (Lux) Bond Fund | Credit-Default -Swaps (gekauft) | Credit-Default -Swaps (verkauft) |
|---|---|---|
| – EUR | - EUR | 10 788 558.89 EUR |
| – Euro High Yield (EUR) | 11 606 154.00 EUR | 10 000 000.00 EUR |
| – Global (CHF) | 2 526 934.24 CHF | - CHF |

| UBS (Lux) Bond Fund | Swaps und Forward-Swaps auf Zinssätze (gekauft) | Swaps und Forward-Swaps auf Zinssätze (verkauft) |
|---|---|---|
| – CHF | - CHF | 10 000 000.00 CHF |
| – EUR | 19 002 622.71 EUR | 7 056 139.43 EUR |
| – Global (CHF) | 1 882 579.65 CHF | 16 584 910.94 CHF |

## Erläuterung 7 – Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der TER» der Swiss Funds and Asset Management Association (SFAMA) in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Nettovermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Nettovermögens aus.

TER für die letzten 12 Monate:

| UBS (Lux) Bond Fund | Total Expense Ratio (TER) |
|---|---|
| – AUD F-acc | 0.36% |
| – AUD N-acc | 1.06% |
| – AUD P-acc | 0.97% |
| – AUD P-dist | 0.96% |
| – AUD Q-acc | 0.57% |
| – AUD Q-dist | 0.57% |
| – CHF F-acc | 0.27% |
| – CHF F-dist | 0.27% |
| – CHF I-A1-acc | 0.48% |
| – CHF I-A3-acc | 0.26% |
| – CHF P-acc | 0.96% |
| – CHF P-dist | 0.96% |
| – CHF Q-acc | 0.58% |
| – CHF Q-dist | 0.58% |
| – Convert Europe (EUR) F-acc | 0.42% |
| – Convert Europe (EUR) I-A1-acc | 0.52% |
| – Convert Europe (EUR) (CHF hedged) I-A1-acc | 0.52% |
| – Convert Europe (EUR) I-A1-dist | 0.52% |
| – Convert Europe (EUR) I-X-acc | 0.02% |

| UBS (Lux) Bond Fund | Total Expense Ratio (TER) |
|---|---|
| – Convert Europe (EUR) (CHF hedged) I-X-acc | 0.01% |
| – Convert Europe (EUR) I-X-dist | 0.02% |
| – Convert Europe (EUR) K-1-acc | 1.09% |
| – Convert Europe (EUR) P-acc | 1.86% |
| – Convert Europe (EUR) (CHF hedged) P-acc | 1.84% |
| – Convert Europe (EUR) P-dist | 1.87% |
| – Convert Europe (EUR) Q-acc | 0.97% |
| – Convert Europe (EUR) (CHF hedged) Q-acc | 0.98% |
| – Convert Europe (EUR) Q-dist | 0.99% |
| – Convert Europe (EUR) U-X-dist | 0.01% |
| – EUR F-acc | 0.36% |
| – EUR P-acc | 0.97% |
| – EUR P-dist | 0.97% |
| – EUR Q-acc | 0.57% |
| – EUR Q-dist | 0.58% |
| – Euro High Yield (EUR) F-acc | 0.54% |
| – Euro High Yield (EUR) I-A1-acc | 0.64% |
| – Euro High Yield (EUR) I-A2-acc | 0.60% |
| – Euro High Yield (EUR) I-B-acc | 0.09% |
| – Euro High Yield (EUR) I-B-mdist | 0.08% |
| – Euro High Yield (EUR) I-X-acc | 0.02% |
| – Euro High Yield (EUR) (CHF hedged) I-X-acc | 0.01% |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) K-1-6%-mdist | 0.79% |
| – Euro High Yield (EUR) K-1-acc | 0.76% |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) K-1-acc | 0.76% |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) K-1-mdist | 0.77% |
| – Euro High Yield (EUR) N-dist | 1.81% |
| – Euro High Yield (EUR) P-6%-mdist | 1.35% |
| – Euro High Yield (EUR) P-acc | 1.32% |
| – Euro High Yield (EUR) (CHF hedged) P-acc | 1.31% |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) P-acc | 1.32% |
| – Euro High Yield (EUR) P-dist | 1.33% |
| – Euro High Yield (EUR) P-mdist | 1.32% |
| – Euro High Yield (EUR) (JPY) P-mdist | 1.32% |
| – Euro High Yield (EUR) (AUD hedged) P-mdist | 1.32% |
| – Euro High Yield (EUR) (CAD hedged) P-mdist | 1.32% |
| – Euro High Yield (EUR) (GBP hedged) P-mdist | 1.32% |
| – Euro High Yield (EUR) (HKD hedged) P-mdist | 1.31% |
| – Euro High Yield (EUR) (RMB hedged) P-mdist | 1.31% |
| – Euro High Yield (EUR) (SGD hedged) P-mdist | 1.32% |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) P-mdist | 1.31% |
| – Euro High Yield (EUR) Q-6%-mdist | 0.81% |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) Q-6%-mdist | 0.79% |
| – Euro High Yield (EUR) Q-acc | 0.79% |
| – Euro High Yield (EUR) (CHF hedged) Q-acc | 0.80% |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) Q-acc | 0.80% |
| – Euro High Yield (EUR) Q-dist | 0.80% |
| – Euro High Yield (EUR) Q-mdist | 0.79% |
| – Euro High Yield (EUR) (GBP hedged) Q-mdist | 0.79% |
| – Euro High Yield (EUR) (USD hedged) Q-mdist | 0.78% |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) F-acc | 0.39% |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) (EUR hedged) F-acc | 0.54% |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) I-A1-acc | 0.70% |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) I-X-acc | 0.02% |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) I-X-dist | 0.02% |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) (EUR hedged) N-acc | 1.81% |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) P-acc | 1.56% |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) (EUR hedged) P-acc | 1.56% |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) (SGD hedged) P-acc | 1.55% |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) (EUR hedged) P-dist | 1.56% |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) P-mdist | 1.56% |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) (SGD hedged) P-mdist | 1.56% |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) Q-acc | 0.86% |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) (EUR hedged) Q-acc | 0.88% |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) (EUR hedged) Q-dist | 0.88% |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) Q-mdist | 0.86% |
| – GBP F-acc | 0.36% |
| – GBP P-acc | 0.96% |
| – GBP P-dist | 0.96% |
| – GBP Q-acc | 0.57% |
| – GBP Q-dist | 0.56% |
| – Global (CHF) (CAD hedged) F-acc | 0.32% |
| – Global (CHF) P-acc | 1.21% |
| – Global (CHF) (CAD hedged) P-acc | 1.15% |
| – Global (CHF) (EUR hedged) P-acc | 1.21% |
| – Global (CHF) (JPY hedged) P-acc | 1.21% |
| – Global (CHF) P-dist | 1.21% |
| – Global (CHF) (CAD hedged) P-dist | 1.15% |
| – Global (CHF) (EUR hedged) P-dist | 1.21% |
| – Global (CHF) Q-acc | 0.67% |
| – Global (CHF) (CAD hedged) Q-acc | 0.60% |
| – Global (CHF) Q-dist | 0.68% |
| – Global (CHF) (CAD hedged) Q-dist | 0.61% |
| – USD F-acc | 0.36% |
| – USD P-acc | 0.96% |
| – USD P-dist | 0.96% |
| – USD Q-acc | 0.57% |
| – USD Q-dist | 0.57% |

Die TER für die Anteilsklassen die weniger als 12 Monaten im Umlauf waren, wurden annualisiert.

Transaktionskosten und gegebenenfalls angefallene Kosten im Zusammenhang mit Währungsabsicherungen sind nicht in der TER enthalten.

## Erläuterung 8 – Wertpapiere vom Verwaltungsrat mit Null bzw. annähernd Null bewertet

Basierend auf dem Vorschlag des UBS Valuation Committee hat der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft beschlossen folgende Wertpapiere mit Null bzw. annähernd Null zu bewerten:

| ISIN | Wertpapiere |
|---|---|
| XS0310904155 | SNS REAAL GROEP-SUB *DEFAULT* 6.258%/3M EURIBOR+229BP 07-PRP |
| USG47709AB95 | ALADDIN CDO I LTD-REG-S *DEFAULT* 3M LIBOR+750BP 06-31.10.16 |
| XS0552743048 | SNS BANK NV-SUB *DEFAULT* 6.25000% 10-26.10.20 |
| DE000A0N0N07 | ARCANDOR AG *DEFAULT* 8.87500% 08-11.07.13 |
| XS0742395287 | AFRICAN MINERALS *DEFAULT* 8.50000% 12-10.02.17 |

## Erläuterung 9 – Fusion

Folgende Fusion fand statt:

| Subfond | fusioniert in | Datum |
|---|---|---|
| UBS (Lux) Bond Fund – CAD | UBS (Lux) Bond Fund – Global (CHF) | 23.9.2016 |

## Erläuterung 10 – Anwendbares Recht, Gerichtsstand und massgebende Sprache

Für sämtliche Rechtsstreitigkeiten zwischen den Anteilinhabern, der Verwaltungsgesellschaft und der Verwahrstelle ist das Bezirksgericht Luxemburg zuständig. Es findet luxemburgisches Recht Anwendung. Die Verwaltungsgesellschaft und/oder die Verwahrstelle können sich und den Fonds jedoch im Zusammenhang mit Forderungen von Anlegern aus anderen Ländern dem Gerichtsstand jener Länder unterwerfen, in denen Anteile angeboten und verkauft werden.

Die deutsche Fassung dieses Berichtes ist massgebend. Die Verwaltungsgesellschaft und die Verwahrstelle können jedoch von ihnen genehmigte Übersetzungen in Sprachen der Länder, in welchen Anteile angeboten und verkauft werden, für sich und den Fonds als verbindlich bezüglich solcher Anteile anerkennen, die an Anleger dieser Länder verkauft wurden.

## Erläuterung 11 – Securities Lending

Der Fonds darf ebenfalls Teile seines Wertpapierbestandes an Dritte ausleihen. Im allgemeinen dürfen Ausleihungen nur über anerkannte Clearinghäuser, wie Clearstream International oder Euroclear, sowie über erstrangige Finanzinstitute, welche in dieser Aktivität spezialisiert sind, innerhalb deren festgesetzten Rahmenbedingungen erfolgen. Collateral erhält man in Verbindung mit ausgeliehenen Wertpapieren. Collateral setzt sich aus hochwertigen Wertpapieren zusammen, welche zumindest dem Betrag des Marktwertes der ausgeliehenen Wertpapiere entsprechen.

UBS (Luxembourg) S.A. agiert als Securities Lending Agent.

| **UBS (Lux) Bond Fund** | **Kurswert** |
|---|---|
| – CHF | 740 450.00 CHF |
| – Convert Europe (EUR) | 25 930 828.15 EUR |
| – EUR | 99 608 951.82 EUR |
| – Euro High Yield (EUR) | - EUR |
| – Full Cycle Asian Bond (USD) | 56 665 413.03 USD |
| – GBP | 4 141 661.28 GBP |
| – Global (CHF) | 29 064 628.22 CHF |
| – USD | 29 154 816.21 USD |



© UBS 2016. Das Schlüsselsymbol und UBS gehören zu den geschützten Marken von UBS. Alle Rechte vorbehalten.
Erscheint auch in englischer Sprache. 80208D-1602