

ZKB Tracker-Zertifikat Dynamisch auf einen Südeuropa Basket II

04.11.2016 - 04.11.2019 | Valor 32 771 910

Neuemission

1. Produktbeschreibung

Derivatekategorie/Bezeichnung

Partizipationsprodukt/Tracker-Zertifikat (1300, gemäss Swiss Derivative Map des Schweizerischen Verbands für Strukturierte Produkte)

KAG Hinweis

Hierbei handelt es sich um ein Strukturiertes Produkt. Das Strukturierte Produkt ist keine kollektive Kapitalanlage im Sinne des Kollektivanlagegesetzes (KAG) und untersteht keiner Genehmigungspflicht und keiner Aufsicht der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA. Die Anleger tragen ferner ein Emittentenrisiko.

Titeluniversum

Das massgebende Titeluniversum besteht aus Unternehmensaktien aus Südeuropa. Die Aktien sind an einer anerkannten Börse (World Federation of Exchanges oder FESE (Federation of European Securities Exchanges) kotiert. Die aktuelle Zusammensetzung des Basiswertes kann unter www.zkb.ch/strukturierteprodukte jederzeit öffentlich eingesehen werden.

Rebalancing

Der Investment Manager bewirtschaftet quartalsweise am 15. März, 15. Juni, 15. September und 15. Dezember (modified following business day convention), erstmals am 15. Dezember 2016 die Portfoliozusammensetzung aufgrund seiner qualifizierten Beurteilung des Marktumfeldes. Bei Auswahl der einzelnen Basiswerte achtet der Investment Manager auf eine hinreichende Liquidität und Handelbarkeit. Das Rebalancing erfolgt interessewährend auf Auftragsbasis zu aktuellen Marktwerten der zugrundeliegenden Basiswerte (Durchschnitt der durch die Emittentin in die Basketwährung umgerechneten Nettokurse der Basiswerte). Die Rebalancing-Periode kann durch die Emittentin bei eingeschränkter Marktliquidität ausgedehnt werden. Die aktuelle Basiswertzusammensetzung wird jeweils im Anhang an die Final Terms aufgeführt.

Emittentin

Zürcher Kantonalbank, Zürich

Rating der Emittentin

Bei Emissionen der Zürcher Kantonalbank: Standard & Poor's AAA, Moody's Aaa, Fitch AAA

Lead Manager, Zahl-, Ausübungs- und Berechnungsstelle

Zürcher Kantonalbank, Zürich

Investment Manager

Investas AG, Bern
Investas AG verfügt über eine FINMA Bewilligung als Vermögensverwalterin von kollektiven Kapitalanlagen.

Symbol/ Valorennummer/ISIN

SUEDEZ/
32 771 910/CH0327719107

Emissionsbetrag/Nennbetrag/ Handelseinheit

EUR 8'500'000.00/EUR 85.00/1 Strukturiertes Produkt oder ein Mehrfaches davon

Anzahl der Strukturierten Produkte

Bis zu 100'000, mit der Möglichkeit der Aufstockung

Ausgabepreis

EUR 85.00 / 101.5228% des Basketwertes am Initial Fixing Tag

Währung

EUR

Basiswert per Initial Fixing Tag

Komponente	ISIN / Bloomberg	Börse	*Währung / Initial Fixing Wert	Gewicht in %	Anzahl Aktien
Acerinox SA	ES0132105018 /ACX SM	Mercato Continuo Espanol	11.2097	3.00	0.224083

Almirall SA	ES0157097017 /ALM SM	Mercado Continuo Espanol	13.1411	4.00	0.254865
Anima Holding S.p.A.	IT0004998065 /ANIM IM	Borsa Italiana	4.4356	3.00	0.566311
APPLUS SERVICES SA	ES0105022000 /APPS SM	Mercado Continuo Espanol	8.6171	3.00	0.291503
ArcelorMittal SA	LU0323134006 /MT NA	Euronext Amsterdam	6.0877	3.00	0.412622
Assicurazioni Generali SPA	IT0000062072 /G IM	Borsa Italiana	11.8066	3.00	0.212755
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	ES0113211835 /BBVA SM	Mercado Continuo Espanol	6.5729	4.00	0.509551
Banco Santander SA	ES0113900J37 /SAN SM	Mercado Continuo Espanol	4.4995	4.00	0.744358
Distribuidora Internacional de Alimentacion	ES0126775032 /DIA SM	Mercado Continuo Espanol	4.9197	3.00	0.510585
Duro Felguera SA	ES0162600417 /MDF SM	Mercado Continuo Espanol	1.0878	3.00	2.309262
ENCE Energia y Celulosa SA	ES0130625512 /ENC SM	Mercado Continuo Espanol	1.9893	3.00	1.262705
Fiat Chrysler Automobiles N.V.	NL0010877643 /FCA IM	Borsa Italiana	6.6110	3.00	0.379961
Global Dominion Access S.A	ES0105130001 /DOM SM	Mercado Continuo Espanol	2.8260	4.00	1.185138
Intesa Sanpaolo SpA	IT0000072618 /ISP IM	Mercado Continuo Italiano	2.1423	4.00	1.563403
International Consolidated Airlines Group SA	ES0177542018 /IAG SM	Mercado Continuo Espanol	4.8494	3.00	0.517982
Leonardo-Finmeccanica Spa	IT0003856405 /LDO IM	Borsa Italiana	11.0491	3.00	0.227340
Mota-Engil SGPS SA	PTMEN0AE0005 /EGL PL	Euronext Lisbon (not PEX)	1.7837	3.00	1.408253
NH Hoteles SA	ES0161560018 /NHH SM	Mercado Continuo Espanol	4.0174	3.00	0.625263
Novabase SGPS	PTNBA0AM0006 /NBA PL	Euronext Paris	2.2613	3.00	1.110846
Sacyr S.A.	ES0182870214 /SCYR SM	Mercado Continuo Espanol	2.0963	3.00	1.198283
SAES Getters SpA	IT0001029492 /SG IM	Borsa Italiana	11.9550	3.00	0.210113
SARAS S.p.A. - Raffinerie Sarde	IT0000433307 /SRS IM	Borsa Italiana	1.5257	3.00	1.646392
Sogefi SPA	IT0000076536 /SO IM	Borsa Italiana	2.0341	3.00	1.234895
Sonae SGPS SA	PTSON0AM0001 /SON PL	Euronext Lisbon (not PEX)	0.7266	4.00	4.609731
STMicroelectronics NV	NL0000226223 /STM IM	Borsa Italiana	8.4142	4.00	0.398044
Talgo S.A.	ES0105065009 /TLGO SM	Mercado Continuo Espanol	4.2593	3.00	0.589752
Telefonica SA	ES0178430E18 /TEF SQ	Mercado Continuo Espanol	9.2230	3.00	0.272352
Tenaris SA	LU0156801721 /TEN IM	Borsa Italiana	13.0693	3.00	0.192199
Trevi-Finanziaria Industriale SPA	IT0001351383 /TFI IM	Borsa Italiana	1.3351	3.00	1.881503
Unione di Banche Italiane ScpA	IT0003487029 /UBI IM	Mercado Continuo	2.5084	3.00	1.001415

Yoox SpA	IT0003540470 /YNAP IM	Italiano Mercato Continuo Italiano	26.4764	3.00	0.094873
----------	--------------------------	---------------------------------------------	---------	------	----------

* Lokale Steuern, Transaktionskosten und ausländische Kommissionen sind, falls anwendbar, bereits im Initial Fixing Wert jeder Komponente enthalten und werden damit durch die Inhaber vom Strukturierten Produkt getragen. Dies gilt insbesondere, obwohl nicht abschliessend, im Zusammenhang mit der Ausübung von mit dem Strukturierten Produkt verbundenen Rechten und/oder bei einem Rebalancing.

Basketwert	EUR 83.73 am Initial Fixing Tag
	Die Bedingungen dieser Emission wurden aufgrund von Corporate Actions angepasst, siehe Tabelle Kapitalereignisse.
Ratio	1 ZKB Tracker-Zertifikat Dynamisch entspricht 1 Basiswert
Ausschüttungen	Es finden keine Ausschüttungen an den Anleger statt. Die von den Basiswertkomponenten ausgeschütteten Dividenden fliessen gänzlich als sogenannte Nettodividenden dem Strukturierten Produkt zur Wiederinvestition zu. Die Nettodividenden entsprechen den Bruttodividenden abzüglich den durch die Emittentin nicht rückforderbaren in- und ausländischen Steuern.
Initial Fixing Tag	Von 28. Oktober 2016 bis 31. Oktober 2016
Liberierungstag	4. November 2016
Letzter Handelstag	28. Oktober 2019
Final Fixing Tag	Von 28. Oktober 2019 bis 29. Oktober 2019
Rückzahlungstag	4. November 2019
Initial Fixing Wert	Von 28. Oktober 2016 bis 31. Oktober 2016, Durchschnitt der interessewährend durch die Emittentin erzielten Nettokurse der Basiswertkomponente/n (die Emittentin kann die Initial Fixing Periode in alleiniger Kompetenz ausdehnen, falls sie dies aufgrund aktueller Marktbedingungen wie beispielsweise Liquidität als nötig erachtet) Lokale Steuern, Transaktionskosten und ausländische Kommissionen sind bereits im Initial Fixing Wert jeder Komponente enthalten falls anwendbar.
Final Fixing Wert	Von 28. Oktober 2019 bis 29. Oktober 2019, Durchschnitt der interessewährend durch die Emittentin erzielten Nettokurse der Basiswertkomponente/n (die Emittentin kann die Final Fixing Periode in alleiniger Kompetenz ausdehnen, falls sie dies aufgrund aktueller Marktbedingungen wie beispielsweise Liquidität als nötig erachtet) Lokale Steuern, Transaktionskosten und ausländische Kommissionen sind bereits im Final Fixing Wert jeder Komponente enthalten falls anwendbar.
Rückzahlungsmodalitäten	Am Rückzahlungstag erhält der Anleger für jedes Strukturierte Produkt 100% des Basiswertes gemäss Final Fixing Tag und gemäss dieser Formel bar ausbezahlt: $\sum_{i=1}^N S_{i,T} \times W_{i,T} - \text{Gebühren}$ wobei $S_{i,T}$ = Wert der Basiswertkomponente i am Final Fixing Tag $W_{i,T}$ = Gewichtung der Basiswertkomponente i (Anzahl Basiswerte) am Final Fixing Tag Gebühren = Jährliche Gebühr T = Final Fixing Tag
	Finden während der Laufzeit des ZKB Tracker-Zertifikat Dynamisch Kapitalereignisse statt, welche bei Emission des Strukturierten Produktes nicht bekannt waren, so werden diese durch entsprechende Anpassung der Gewichtung der betroffenen Basiswertkomponente angeglichen.
Kotierung	Wird an der SIX Swiss Exchange beantragt, erster provisorischer Handelstag am 4. November 2016.
Jährliche Gebühr	0.85% p.a. Die Gebühr wird auf dem Produktwert belastet und pro rata temporis im täglichen Handelspreis berücksichtigt. Von der jährlichen Gebühr entfallen 0.35% p.a. auf die Emittentin für die Administration und 0.50% p.a. auf den Investment Manager für die diskretionäre Verwaltung des Strukturierten Produktes.

Clearingstelle	SIX SIS AG/Euroclear/Clearstream				
Total Expense Ratio (TER) / Vertriebsentschädigungen	<p>Im Sinne der Definitionen der Swiss Funds & Asset Management Association wird eine TER von 1.35% p.a. angestrebt.</p> <p>Die TER benennt sämtliche im Produkt verrechneten Produktions- und Vertriebsentschädigungen. Einmalig anfallende Kosten werden bei der Berechnung der TER auf die gesamte Laufzeit verteilt. Allfällige Risiko- und Transaktionskosten, wie sie zum Beispiel bei Optionen in Form von Geld-Brief Spannen existieren, finden keine Berücksichtigung. Bei diesem Strukturierten Produkt können Vertriebsentschädigungen in Form eines Rabattes auf dem Ausgabepreis, als Vergütung eines Teils des Ausgabepreises oder in Form anderer einmalig und/oder periodisch anfallender Gebühren an einen oder mehrere Vertriebspartner bezahlt worden sein. Allfällige Vertriebsentschädigungen sind in der TER enthalten und können bis zu 0.33% p.a. betragen.</p>				
Sales: 044 293 66 65	<table border="0"> <tr> <td>SIX Telekurs: 85,ZKB</td> <td>Reuters: ZKBSTRUCT</td> </tr> <tr> <td>Internet: www.zkb.ch/strukturierteprodukte</td> <td>Bloomberg: ZKBY <go></td> </tr> </table>	SIX Telekurs: 85,ZKB	Reuters: ZKBSTRUCT	Internet: www.zkb.ch/strukturierteprodukte	Bloomberg: ZKBY <go>
SIX Telekurs: 85,ZKB	Reuters: ZKBSTRUCT				
Internet: www.zkb.ch/strukturierteprodukte	Bloomberg: ZKBY <go>				
Wesentliche Produktmerkmale	Der Kauf dieses Strukturierten Produktes entspricht wertmässig dem Kauf des zugrunde liegenden Basiswertes abzüglich der Gebühren. Der Anleger erhält in einer einzigen kostengünstigen Transaktion die Möglichkeit, vollumfänglich an der Performance des Basiswertes teilzunehmen. Dividendenzahlungen von im Basket enthaltenen Basiswertkomponenten werden dem Anleger mittels Reinvestition entschädigt. Die Rückzahlung richtet sich nach dem gewichteten Wert der im Basket enthaltenen Basiswertkomponenten am Final Fixing Tag.				
Steuerliche Aspekte	<p>Die Emittentin erstellt jeweils per 31. Oktober** jeden Jahres zu Händen der Eidg. Steuerverwaltung ein Reporting. Darin wird die Wertentwicklung (Veränderung zum Vorjahreswert) in die Komponenten Ertrag und Kapitalgewinn aufgeteilt und ausgewiesen. Die Ertragskomponente unterliegt dabei per Stichtag der Einkommenssteuer. Die Kapitalgewinnkomponente ist steuerfrei.</p> <p>Es wird keine Eidg. Verrechnungssteuer erhoben. Das Produkt unterliegt im Sekundärmarkt nicht der Eidg. Umsatzabgabe. Das Produkt ist bei einer schweizerischen Zahlstelle nicht dem System des EU-Steuerückhalts unterstellt (SIX Telekurs EU-Tax Klassifizierungscode: 9, „out of scope“).</p> <p>Die vorstehenden Hinweise zur Besteuerung sind lediglich eine Zusammenfassung dessen, wie die Emittentin unter dem derzeit geltenden Recht und der gängigen Praxis der Eidgenössischen Steuerverwaltung in der Schweiz die Besteuerung dieser Strukturierten Produkte im Zeitpunkt der Emission versteht. Die Steuergesetzgebung und die Praxis können sich ändern. Die Emittentin schliesst jegliche Haftung für die vorstehenden Hinweise aus. Diese allgemeinen Hinweise können die steuerliche Beratung des einzelnen Anlegers nicht ersetzen.</p>				
Dokumentation	<p>Dieses Dokument stellt die Endgültigen Bedingungen (Final Terms) gemäss Artikel 21 des Zusatzreglements für die Kotierung von Derivaten der SIX Swiss Exchange dar. Diese Endgültigen Bedingungen (Final Terms) ergänzen das in deutscher Sprache veröffentlichte Emissionsprogramm der Emittentin vom 15. April 2016 in der zum Zeitpunkt der Emission geltenden Fassung. Diese Endgültigen Bedingungen (Final Terms) und das Emissionsprogramm bilden gemeinsam den Emissions- und Kotierungsprospekt für die vorliegende Emission (der 'Kotierungsprospekt'). In diesen Endgültigen Bedingungen (Final Terms) verwendete Begriffe haben die im Glossar des Emissionsprogramms definierte Bedeutung, sofern in diesen Endgültigen Bedingungen (Final Terms) nicht etwas anderes bestimmt wird. Sollten Widersprüche zwischen den Informationen oder Bestimmungen in diesen Endgültigen Bedingungen (Final Terms) und jenen im Emissionsprogramm bestehen, so haben die Informationen und Bestimmungen in diesen Endgültigen Bedingungen (Final Terms) Vorrang. Strukturierte Produkte werden als Wertrechte begeben und bei der SIX SIS AG als Bucheffekten geführt. Die Ausgabe von Wertpapieren oder Beweisurkunden ist ausgeschlossen. Diese Endgültigen Bedingungen (Final Terms) sowie das Emissionsprogramm können kostenlos bei der Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich, Abteilung IFSP sowie über die E-Mailadresse documentation@zkb.ch bezogen werden. Dieses Dokument stellt keinen Emissionsprospekt im Sinne von Art. 652a bzw. 1156 OR dar.</p>				
Angaben zum Basiswert	Informationen über die Wertentwicklung der Basiswerte / Basiswertkomponenten können öffentlich unter www.bloomberg.com eingesehen werden. Des Weiteren können die aktuellen Jahresberichte direkt über die Webseite des Unternehmens abgerufen werden. Die Übertragbarkeit der Basiswerte / Basiswertkomponenten richtet sich nach deren Statuten.				

Mitteilungen

Alle Mitteilungen seitens der Emittentin betreffend dieses Strukturierten Produktes, insbesondere Mitteilungen bezüglich der Anpassung der Bedingungen, werden rechtsgültig über die Internetadresse <https://zkb-finance.mdgms.com/products/stp/index.html> zum entsprechenden Strukturierten Produkt publiziert. Über die Valorensuchfunktion kann direkt auf das gewünschte Strukturierte Produkt zugegriffen werden. Die Mitteilungen gemäss den von der SIX Swiss Exchange erlassenen, für das IBL (Internet Based Listing) gültigen Vorschriften, werden unter <https://www.six-exchange-regulation.com/de/home/publications/official-notice.html> veröffentlicht.

Rechtswahl/Gerichtsstand

Schweizer Recht/Zürich 1

2. Gewinn- und Verlustaussichten per Jahr 1

Gewinn- und Verlustaussichten per Jahr 1

ZKB Tracker-Zertifikat Dynamisch

Basket		Rückzahlung	
Wert	Prozent	ZKB Tracker-Zertifikat Dynamisch	Performance %
EUR 58.61	-30.00%	EUR 58.11	-31.64%
EUR 66.98	-20.00%	EUR 66.41	-21.87%
EUR 75.35	-10.00%	EUR 74.71	-12.1%
EUR 85.00	+1.52%	EUR 84.28	-0.85%
EUR 92.10	+10.00%	EUR 91.31	7.43%
EUR 100.47	+20.00%	EUR 99.62	17.2%
EUR 108.84	+30.00%	EUR 107.92	26.96%

Quelle: Zürcher Kantonalbank

Die Performance des ZKB Tracker-Zertifikat Dynamisch ist analog zur Performance des Basiswerts abzüglich der Gebühren.

Die obenstehende Tabelle gilt per Jahr 1 und kann nicht als Preisindikation der Emittentin für das vorliegende Strukturierte Produkt während der Laufzeit verwendet werden. Während der Laufzeit des Strukturierten Produktes kommen zusätzliche Risikofaktoren hinzu, welche den Wert des Strukturierten Produktes entscheidend beeinflussen. Der im Sekundärmarkt gestellte Preis kann daher deutlich von der obenstehenden Tabelle abweichen.

3. Bedeutende Risiken für die Anlegerinnen und Anleger

Emittentenrisiko

Verpflichtungen aus diesem Strukturierten Produkt stellen direkte, unbedingte und ungesicherte Verpflichtungen der Emittentin dar und stehen im gleichen Rang wie alle anderen direkten, unbedingten und ungesicherten Verpflichtungen der Emittentin. Die Werthaltigkeit des Strukturierten Produktes ist nicht allein von der Entwicklung des Basiswertes und anderen Entwicklungen auf den Finanzmärkten abhängig, sondern auch von der Bonität der Emittentin. Diese kann sich während der Laufzeit dieser Strukturierten Produkte verändern.

Spezifische Produkterisiken

Strukturierte Produkte sind komplexe Anlageinstrumente, welche hohe Risiken enthalten können und entsprechend nur für erfahrene Anleger gedacht sind, welche die damit verbundenen Risiken verstehen und zu tragen fähig sind. Diese Strukturierten Produkte sind Anlageprodukte deren Kurs im selben Ausmass wie der zugrunde liegende Basiswert schwankt abzüglich der Gebühren. Je nach Entwicklung kann der Kurs eines ZKB Tracker-Zertifikat Dynamisch erheblich unter den Emissionspreis fallen. Die Risikocharakteristik entspricht derjenigen des zugrunde liegenden Basiswertes. Das Zertifikat ist in EUR denominiert. Weicht die Referenzwährung des Anlegers vom EUR ab, trägt dieser das Wechselkursrisiko zwischen seiner Referenzwährung und dem EUR.

4. Weitere Bestimmungen

Anpassungen

Tritt bezüglich des Basiswertes/einer Basiswertkomponente ein in Abschnitt IV des Emissionsprogramms beschriebenes ausserordentliches Ereignis ein oder tritt irgend ein anderes ausserordentliches Ereignis ein, welches es der Emittentin verunmöglicht oder übermässig erschwert, die Rechte aus den Strukturierten Produkten zu erfüllen oder den Wert der Strukturierten Produkte zu bestimmen, trifft die Emittentin, nach freiem Ermessen die geeigneten Massnahmen und hat, falls notwendig die Bedingungen der Strukturierten Produkte derart anzupassen, dass der wirtschaftliche Wert des Strukturierten Produktes nach dem Eintritt des Ereignisses so weit möglich dem wirtschaftlichen Wert des Strukturierten Produktes vor Eintritt des Ereignisses entspricht. Spezifische Anpassungsregeln für einzelne Arten von Basiswerten im Abschnitt IV des Emissionsprogramms gehen dieser Bestimmung vor. Ist nach Ansicht der Emittentin eine sachgerechte Anpassung, aus welchen Gründen auch immer, nicht möglich, ist die Emittentin berechtigt, die Strukturierten Produkte vorzeitig zu kündigen.

Marktstörungen

Vergleiche die Ausführungen im Emissionsprogramm.

Verkaufsbeschränkungen

Es gelten die im Emissionsprogramm detaillierten Verkaufsbeschränkungen - EWR, U.S.A./U.S. persons, Guernsey.

Insbesondere darf dieses Dokument und die darin enthaltenen Informationen nicht an Personen, die möglicherweise US-Personen nach der Definition der Regulation S des US Securities Act von 1933 sind, verteilt und/oder weiterverteilt werden. Definitionsgemäss umfasst «US Person» jede natürliche US-Person oder juristische Person, jedes Unternehmen, jede Firma, Kollektivgesellschaft oder sonstige Gesellschaft, die nach amerikanischem Recht gegründet wurde. Im Weiteren gelten die Kategorien der Regulation S.

Die Emittentin hat keinerlei Massnahmen ergriffen und wird keinerlei Massnahmen ergreifen, um das öffentliche Angebot der Strukturierten Produkte oder ihren Besitz oder den Vertrieb von Angebotsunterlagen in Bezug auf Strukturierte Produkte in irgendeiner Rechtsordnung ausserhalb der Schweiz zulässig zu machen. Die Aushändigung dieser Endgültigen Bedingungen (Final Terms) oder anderer Emissionsunterlagen und das Angebot der Strukturierten Produkte in bestimmten Ländern kann durch Rechtsvorschriften eingeschränkt sein. Personen, denen diese Endgültigen Bedingungen (Final Terms) oder andere Emissionsunterlagen wie das Emissionsprogramm, Termsheets, Werbeunterlagen oder sonstige Verkaufsunterlagen ausgehändigt wurden, werden von der Emittentin hiermit aufgefordert, die jeweils geltenden Einschränkungen zu überprüfen und einzuhalten.

Prudentielle Aufsicht

Die Zürcher Kantonalbank untersteht als Bank im Sinne des Bundesgesetzes über die Banken und Sparkassen (BankG; SR 952.0) und als Effektenhändlerin im Sinne des Bundesgesetzes über die Börsen und den Effektenhandel (BEHG; SR 954.1) der prudentiellen Aufsicht der FINMA, Laupenstrasse 27, CH-3003 Bern, <http://www.finma.ch>.

Aufzeichnung von Telefongesprächen

Die Anleger werden darauf hingewiesen, dass Telefonate mit Handels- und Verkaufseinheiten der Zürcher Kantonalbank aufgezeichnet werden. Anleger, die Telefongespräche mit diesen Einheiten führen, stimmen der Aufzeichnung stillschweigend zu.

Zürich, 31. Oktober 2016, letztes Update am 11. Oktober 2019

**Änderung per 4. September 2017:

alt: 15. Dezember

neu: 31. Oktober

Basiswert am 11.10.2019

Komponente	ISIN / Bloomberg	Börse	*Währung / Initial Fixing Wert	Gewicht in %	Anzahl Aktien
ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	ES0167050915 /ACS SQ	Madrid	37.3444	3.00	0.073792
Almirall SA	ES0157097017 /ALM SQ	Madrid	15.6273	3.29	0.193638
ArcelorMittal SA	LU1598757687 /MT NA	Euronext Amsterdam	14.5298	3.00	0.189659
Assicurazioni Generali SPA	IT0000062072 /G IM	Borsa Italiana	16.1974	3.36	0.190405
Autogrill SpA	IT0001137345 /AGL IM	Borsa Italiana	9.4500	3.42	0.332436
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	ES0113211835 /BBVA SM	Mercato Continuo Espanol	4.9168	2.80	0.523140
Banco de Sabadell SA	ES0113860A34 /SAB SQ	Madrid	0.9263	3.00	2.975097
Banco Santander SA	ES0113900J37 /SAN SM	Mercado Continuo Espanol	3.9724	3.00	0.693715
Cairo Communication SPA	IT0004329733 /CAI IM	Borsa Italiana	2.7159	3.00	1.014658
Cellnex Telecom S.A.	ES0105066007 /CLNX SQ	Madrid	32.1252	3.00	0.091765
Cerved Group S.p.A.	IT0005010423 /CERV IM	Borsa Italiana	7.9600	3.11	0.358806
CIR Compagnie Industriali Riunite SpA	IT0000080447 /CIR IM	Borsa Italiana	0.9363	2.73	2.683227
Ebro Foods SA	ES0112501012 /EBRO SQ	Madrid	19.2462	3.37	0.160654
ENEL SpA	IT0003128367 /ENEL IM	Borsa Italiana	6.0809	3.00	0.453175
Grupo Ezentis SA	ES0172708234 /EZE SQ	Madrid	0.5030	2.75	5.027538
Iberdrola SA	ES0144580Y14 /IBE SM	Mercato Continuo Espanol	8.9353	3.00	0.308406
Industria de Diseno Textil SA	ES0148396007 /ITX SQ	Madrid	25.1038	3.00	0.109773
Intesa Sanpaolo SpA	IT0000072618 /ISP IM	Mercato Continuo Italiano	1.8407	2.80	1.397217
International Consolidated Airlines Group SA	ES0177542018 /IAG SQ	Madrid	5.1820	3.30	0.585510
Jeronimo Martins SGPS SA	PTJMT0AE0001 /JMT PL	Euronext Lisbon (not PEX)	14.3949	2.81	0.179610
Liberbank SA	ES0168675090 /LBK SQ	Madrid	0.3669	3.20	8.007850
Maire Tecnimont S.p.A.	IT0004931058 /MT IM	Borsa Italiana	2.8287	3.00	0.974207
Mota-Engil SGPS SA	PTMENOAE0005 /EGL PL	Euronext Lisbon (not PEX)	1.8730	3.00	1.471270
Novabase SGPS	PTNBA0AM0006 /NBA PL	Euronext Paris	2.2554	3.03	1.233865
Promotora de Informaciones SA	ES0171743901 /PRS SQ	Madrid	1.4406	2.76	1.761865
Prysmian SpA	IT0004176001 /PRY IM	Mercato Continuo Italiano	16.9775	3.00	0.162315
Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SPA	IT0003828271 /REC IM	Borsa Italiana	37.0814	3.00	0.074315
Red Electrica Corporacion SA	ES0173093024 /REE SQ	Mercato Continuo Espanol	19.4521	3.13	0.147651

REN - Redes Energeticas Nacionales SGPS SA	PTRELOAM0008 /RENE PL	Euronext Lisbon (not PEX)	2.4841	3.00	1.109354
Sonae SGPS SA	PTSON0AM0001 /SON PL	Euronext Lisbon (not PEX)	0.8805	3.00	3.129831
Telecom Italia SPA	IT0003497168 /TIT IM	Mercato Continuo Italiano	0.4593	3.38	6.766438
Telepizza Group S.A.	ES0105128005 /TPZ SQ	Madrid	6.0091	3.00	0.458591
Unicredit SpA	IT0005239360 /UCG IM	Mercato Continuo Italiano	10.1685	2.75	0.247993

* Lokale Steuern, Transaktionskosten und ausländische Kommissionen sind, falls anwendbar, bereits im Initial Fixing Wert jeder Komponente enthalten und werden damit durch die Inhaber vom Strukturierten Produkt getragen. Dies gilt insbesondere, obwohl nicht abschliessend, im Zusammenhang mit der Ausübung von mit dem Strukturierten Produkt verbundenen Rechten und/oder bei einem Rebalancing.

Kapitalereignisübersicht

Datum	Basiswert	Ereignis		
		Rebalancing vom 15.12.2016	Anzahl Aktien alt	Anzahl Aktien neu
15.12.2016	Acerinox SA	Rebalancing	0.224083	0.214399
15.12.2016	Almirall SA	Rebalancing	0.254865	0.271610
15.12.2016	Anima Holding S.p.A.	Rebalancing	0.566311	0.559395
15.12.2016	APPLUS SERVICES SA	Rebalancing	0.291503	0.310011
15.12.2016	ArcelorMittal SA	Rebalancing	0.412622	0.424875
15.12.2016	Arnoldo Mondadori Editore SPA	Kauf	-	3.375140
15.12.2016	Assicurazioni Generali SPA	Rebalancing	0.212755	0.193669
15.12.2016	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Rebalancing	0.509551	0.491869
15.12.2016	Banco Santander SA	Rebalancing	0.744358	0.693079
15.12.2016	Distribuidora Internacional de Alimentacion	Rebalancing	0.510585	0.523455
15.12.2016	Duro Felguera SA	Rebalancing	2.309262	2.310591
15.12.2016	ENCE Energia y Celulosa SA	Rebalancing	1.262705	1.280547
15.12.2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V.	Rebalancing	0.379961	0.362852
15.12.2016	Global Dominion Access S.A	Rebalancing	1.185138	1.235508
15.12.2016	Grupo Ezentis SA	Kauf	-	6.110062
15.12.2016	International Consolidated Airlines Group SA	Rebalancing	0.517982	0.548324
15.12.2016	Intesa Sanpaolo SpA	Rebalancing	1.563403	1.451714
15.12.2016	Leonardo-Finmeccanica Spa	Rebalancing	0.227340	0.224270
15.12.2016	Mota-Engil SGPS SA	Rebalancing	1.408253	1.422291
15.12.2016	NH Hoteles SA	Rebalancing	0.625263	0.658480
15.12.2016	Novabase SGPS	Rebalancing	1.110846	1.206440
15.12.2016	Sacyr S.A.	Rebalancing	1.198283	1.118142
15.12.2016	SAES Getters SpA	Rebalancing	0.210113	0.206698
15.12.2016	Salini Impregilo SpA	Kauf	-	1.114782
15.12.2016	SARAS S.p.A. - Raffinerie Sarde	Verkauf	1.646392	-
15.12.2016	Sogefi SPA	Rebalancing	1.234895	1.174435
15.12.2016	Sonae SGPS SA	Rebalancing	4.609731	4.797115
15.12.2016	STMicroelectronics NV	Verkauf	0.398044	-
15.12.2016	Talgo S.A.	Rebalancing	0.589752	0.689992
15.12.2016	Telefonica SA	Rebalancing	0.272352	0.278801
15.12.2016	Tenaris SA	Verkauf	0.192199	-
15.12.2016	Trevi-Finanziaria Industriale SPA	Rebalancing	1.881503	1.712713
15.12.2016	Unione di Banche Italiane ScpA	Rebalancing	1.001415	0.894761
15.12.2016	Yoox SpA	Rebalancing	0.094873	0.096404
17.01.2017	Leonardo-Finmeccanica Spa	Change of Identification vom 17.01.2017	Name alt Leonardo-Finmec canica Spa	Name neu Leonardo SpA
17.01.2017	Leonardo-Finmeccanica Spa	Change of Identification vom 17.01.2017	Name kurz alt Leonardo-Finmec c A	Name kurz neu Leonardo SpA A
		Rebalancing vom 15.03.2017	Bestand alt	Bestand neu
15.03.2017	Acerinox SA	Verkauf	0.214399	-
15.03.2017	Almirall SA	Rebalancing	0.271610	0.289142
15.03.2017	Anima Holding S.p.A.	Rebalancing	0.559395	0.535852
15.03.2017	APPLUS SERVICES SA	Verkauf	0.310011	-
15.03.2017	ArcelorMittal SA	Rebalancing	0.424875	0.440456
15.03.2017	Arnoldo Mondadori Editore SPA	Rebalancing	3.375140	3.398606
15.03.2017	Assicurazioni Generali SPA	Rebalancing	0.193669	0.192976
15.03.2017	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Rebalancing	0.491869	0.467480
15.03.2017	Banco Comercial Portugues SA	Kauf	-	18.868795
15.03.2017	Banco Santander SA	Rebalancing	0.693079	0.691401
15.03.2017	Distribuidora Internacional de Alimentacion	Rebalancing	0.523455	0.553107
15.03.2017	Duro Felguera SA	Rebalancing	2.310591	2.508693
15.03.2017	EMAK SPA	Kauf	-	2.146344
15.03.2017	ENCE Energia y Celulosa SA	Verkauf	1.280547	-
15.03.2017	Fiat Chrysler Automobiles N.V.	Rebalancing	0.362852	0.372327
15.03.2017	Global Dominion Access S.A	Rebalancing	1.235508	1.295145
15.03.2017	Grupo Ezentis SA	Rebalancing	6.110062	4.943231
15.03.2017	International Consolidated Airlines Group SA	Rebalancing	0.548324	0.556842
15.03.2017	Intesa Sanpaolo SpA	Rebalancing	1.451714	1.361717
15.03.2017	Leonardo SpA	Rebalancing	0.224270	0.227173
15.03.2017	Mota-Engil SGPS SA	Rebalancing	1.422291	1.378501
15.03.2017	NH Hoteles SA	Rebalancing	0.658480	0.712789
15.03.2017	Novabase SGPS	Rebalancing	1.206440	1.221279

Kapitalereignisübersicht

Datum	Basiswert	Ereignis		
15.03.2017	Promotora de Informaciones SA	Kauf	-	0.726462
15.03.2017	Sacyr S.A.	Rebalancing	1.118142	1.154181
15.03.2017	SAES Getters SpA	Verkauf	0.206698	-
15.03.2017	Salini Impregilo SpA	Rebalancing	1.114782	1.156232
15.03.2017	Sogefi SPA	Rebalancing	1.174435	1.128013
15.03.2017	Sonae SGPS SA	Rebalancing	4.797115	4.893005
15.03.2017	Talgo S.A.	Rebalancing	0.689992	0.694962
15.03.2017	Telefonica SA	Rebalancing	0.278801	0.273625
15.03.2017	Trevi-Finanziaria Industriale SPA	Rebalancing	1.712713	1.818677
15.03.2017	Unicredit SpA	Kauf	-	0.247993
15.03.2017	Unione di Banche Italiane ScpA	Rebalancing	0.894761	0.837054
15.03.2017	Yoox SpA	Rebalancing	0.096404	0.104272
18.05.2017	ArcelorMittal SA	Change of Identification vom 18.05.2017	ISIN alt LU0323134006	ISIN neu LU1598757687
18.05.2017	ArcelorMittal SA	Reverse Stock Split vom 18.05.2017	Anzahl Aktien alt 0.440456	Anzahl Aktien neu 0.146819
12.06.2017	Unione di Banche Italiane ScpA	Rights Issue vom 12.06.2017	Anzahl Aktien alt 0.855981	Anzahl Aktien neu 0.898081
		Rebalancing vom 15.06.2017	Bestand alt	Bestand neu
15.06.2017	Almirall SA	Rebalancing	0.289142	0.295224
15.06.2017	Anima Holding S.p.A.	Rebalancing	0.535852	0.504032
15.06.2017	ArcelorMittal SA	Rebalancing	0.146819	0.152873
15.06.2017	Arnoldo Mondadori Editore SPA	Verkauf	3.398606	-
15.06.2017	Assicurazioni Generali SPA	Rebalancing	0.192976	0.192342
15.06.2017	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Rebalancing	0.467480	0.468481
15.06.2017	Banco Comercial Portugues SA	Rebalancing	18.868795	17.985126
15.06.2017	Banco Santander SA	Rebalancing	0.691401	0.677590
15.06.2017	Beni Stabili Spa SIQ	Kauf	-	5.536166
15.06.2017	Distribuidora Internacional de Alimentacion	Rebalancing	0.553107	0.536396
15.06.2017	Duro Felguera SA	Rebalancing	2.508693	3.281965
15.06.2017	EMAK SPA	Rebalancing	2.146344	2.226770
15.06.2017	Fiat Chrysler Automobiles N.V.	Rebalancing	0.372327	0.357928
15.06.2017	Global Dominion Access S.A	Verkauf	1.295145	-
15.06.2017	Grupo Ezentis SA	Rebalancing	4.943231	4.498393
15.06.2017	International Consolidated Airlines Group SA	Rebalancing	0.556842	0.567634
15.06.2017	Intesa Sanpaolo SpA	Rebalancing	1.361717	1.370545
15.06.2017	Leonardo SpA	Rebalancing	0.227173	0.228973
15.06.2017	Mota-Engil SGPS SA	Rebalancing	1.378501	1.395837
15.06.2017	NH Hoteles SA	Rebalancing	0.712789	0.709040
15.06.2017	Novabase SGPS	Rebalancing	1.221279	1.286451
15.06.2017	Obrascon Huarte Lain SA	Kauf	-	1.652329
15.06.2017	Promotora de Informaciones SA	Rebalancing	0.726462	0.934314
15.06.2017	Sacyr S.A.	Rebalancing	1.154181	1.172129
15.06.2017	Salini Impregilo SpA	Verkauf	1.156232	-
15.06.2017	Sogefi SPA	Rebalancing	1.128013	0.718538
15.06.2017	Sonae SGPS SA	Rebalancing	4.893005	4.846784
15.06.2017	Talgo S.A.	Verkauf	0.694962	-
15.06.2017	Telecom Italia SPA	Kauf	-	6.507785
15.06.2017	Telefonica SA	Rebalancing	0.273625	0.279818
15.06.2017	Trevi-Finanziaria Industriale SPA	Rebalancing	1.818677	1.835739
15.06.2017	Unicredit SpA	Rebalancing	0.247993	0.241482
15.06.2017	Unieuro S.p.A.	Kauf	-	0.374430
15.06.2017	Unione di Banche Italiane ScpA	Rebalancing	0.898081	0.807800
15.06.2017	Yoox SpA	Rebalancing	0.104272	0.107455
30.06.2017	Sacyr S.A.	Capital Increase vom 30.06.2017	Anzahl Aktien alt 1.172129	Anzahl Aktien neu 1.207648
03.07.2017	Fiat Chrysler Automobiles N.V.	Erhöhung von GEDI GRUPPO EDITORIALE SPA aufgrund Spin-off auf Fiat Chrysler Automobiles N. V. vom 03.07.2017	Anzahl Aktien alt 0	Anzahl Aktien neu 0.017324
06.07.2017	Banco Santander SA	Capital Increase vom 06.07.2017	Anzahl Aktien alt 0.677590	Anzahl Aktien neu 0.688919
		Rebalancing vom 15.09.2017	Bestand alt	Bestand neu
15.09.2017	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	Kauf	-	0.083152
15.09.2017	Almirall SA	Rebalancing	0.295224	0.274492
15.09.2017	Anima Holding S.p.A.	Rebalancing	0.504032	0.497863
15.09.2017	ArcelorMittal SA	Rebalancing	0.152873	0.154957
15.09.2017	Assicurazioni Generali SPA	Rebalancing	0.192342	0.191450
15.09.2017	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Rebalancing	0.468481	0.479579
15.09.2017	Banco Comercial Portugues SA	Verkauf	17.985126	-
15.09.2017	Banco de Sabadell SA	Kauf	-	2.314825
15.09.2017	Banco Santander SA	Rebalancing	0.688918	0.691223

Kapitalereignisübersicht

Datum	Basiswert	Ereignis		
15.09.2017	Beni Stabili Spa SIIQ	Rebalancing	5.536166	5.648865
15.09.2017	Cairo Communication SPA	Kauf	-	1.188536
15.09.2017	Cellnex Telecom S.A.	Kauf	-	0.133580
15.09.2017	Distribuidora Internacional de Alimentacion	Rebalancing	0.536396	0.576061
15.09.2017	Duro Felguera SA	Verkauf	3.281965	-
15.09.2017	Ebro Foods SA	Kauf	-	0.296407
15.09.2017	EMAK SPA	Rebalancing	2.226770	1.970514
15.09.2017	Fiat Chrysler Automobiles N.V.	Rebalancing	0.357928	0.207714
15.09.2017	Gestamp Automocion	Kauf	-	0.604721
15.09.2017	Grupo Ezentis SA	Rebalancing	4.498393	4.717250
15.09.2017	Gruppo Editoriale L'Espresso SPA	Verkauf	0.017324	-
15.09.2017	International Consolidated Airlines Group SA	Rebalancing	0.567634	0.581173
15.09.2017	Intesa Sanpaolo SpA	Rebalancing	1.370545	1.354956
15.09.2017	Leonardo SpA	Rebalancing	0.228973	0.223681
15.09.2017	Mota-Engil SGPS SA	Rebalancing	1.395837	1.236312
15.09.2017	NH Hoteles SA	Rebalancing	0.709040	0.694789
15.09.2017	Novabase SGPS	Rebalancing	1.286451	1.313786
15.09.2017	Obrascon Huarte Lain SA	Verkauf	1.652329	-
15.09.2017	Promotora de Informaciones SA	Rebalancing	0.934314	0.857469
15.09.2017	Sacyr S.A.	Rebalancing	1.207648	1.280495
15.09.2017	Sogefi SPA	Verkauf	0.718538	-
15.09.2017	Sonae SGPS SA	Rebalancing	4.846784	4.720888
15.09.2017	Telecom Italia SPA	Rebalancing	6.507785	6.857232
15.09.2017	Telefonica SA	Verkauf	0.279818	-
15.09.2017	Trevi-Finanziaria Industriale SPA	Rebalancing	1.835739	1.872726
15.09.2017	Unicredit SpA	Rebalancing	0.241482	0.238155
15.09.2017	Unieuro S.p.A.	Rebalancing	0.374430	0.199847
15.09.2017	Unione di Banche Italiane ScpA	Rebalancing	0.807800	0.796572
15.09.2017	Yoox SpA	Rebalancing	0.107455	0.100206
05.10.2017	Grupo Ezentis SA	Rights Issue vom 05.10.2017	Anzahl Aktien alt 4.717250	Anzahl Aktien neu 4.744459
		Rebalancing vom 15.12.2017	Bestand alt	Bestand neu
15.12.2017	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	Rebalancing	0.083152	0.099981
15.12.2017	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Rebalancing	0.479579	0.484677
15.12.2017	Banco Santander SA	Rebalancing	0.691223	0.695427
15.12.2017	Cellnex Telecom S.A.	Rebalancing	0.133580	0.133813
15.12.2017	Distribuidora Internacional de Alimentacion	Rebalancing	0.576061	0.882867
15.12.2017	Ebro Foods SA	Rebalancing	0.296407	0.298820
15.12.2017	EMAK SPA	Rebalancing	1.970514	2.331990
15.12.2017	Fiat Chrysler Automobiles N.V.	Verkauf	0.207714	-
15.12.2017	Gestamp Automocion	Verkauf	0.604721	-
15.12.2017	International Consolidated Airlines Group SA	Rebalancing	0.581173	0.590235
15.12.2017	Liberbank SA	Kauf	-	7.786763
15.12.2017	Novabase SGPS	Rebalancing	1.313786	1.494368
15.12.2017	Sacyr S.A.	Rebalancing	1.280495	1.903014
15.12.2017	Trevi-Finanziaria Industriale SPA	Verkauf	1.872726	-
15.12.2017	Yoox SpA	Rebalancing	0.100206	0.108677
29.01.2018	Promotora de Informaciones SA	Rights Issue vom 29.01.2018	Anzahl Aktien alt 0.857469	Anzahl Aktien neu 1.546045
		Rebalancing vom 15.03.2018	Bestand alt	Bestand neu
15.03.2018	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	Rebalancing	0.099981	0.094239
15.03.2018	Almirall SA	Rebalancing	0.274492	0.266726
15.03.2018	Anima Holding S.p.A.	Rebalancing	0.497863	0.507643
15.03.2018	ArcelorMittal SA	Rebalancing	0.154957	0.155576
15.03.2018	Assicurazioni Generali SPA	Rebalancing	0.191450	0.190529
15.03.2018	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Rebalancing	0.484677	0.495595
15.03.2018	Banco de Sabadell SA	Rebalancing	2.314825	2.366592
15.03.2018	Banco Santander SA	Rebalancing	0.695427	0.718907
15.03.2018	Beni Stabili Spa SIIQ	Rebalancing	5.648865	5.541416
15.03.2018	Cairo Communication SPA	Rebalancing	1.188536	1.176010
15.03.2018	Cellnex Telecom S.A.	Rebalancing	0.133813	0.136819
15.03.2018	CIR Compagnie Industriali Riunite SpA	Kauf	-	2.563999
15.03.2018	Distribuidora Internacional de Alimentacion	Rebalancing	0.882867	0.893607
15.03.2018	Ebro Foods SA	Rebalancing	0.298820	0.163921
15.03.2018	EMAK SPA	Rebalancing	2.331990	2.348766
15.03.2018	Grupo Ezentis SA	Rebalancing	4.744459	4.782484

Kapitalereignisübersicht

Datum	Basiswert	Ereignis		
15.03.2018	International Consolidated Airlines Group SA	Rebalancing	0.590235	0.591492
15.03.2018	Intesa Sanpaolo SpA	Rebalancing	1.354956	1.376143
15.03.2018	Leonardo SpA	Verkauf	0.223681	-
15.03.2018	Liberbank SA	Rebalancing	7.786763	7.900420
15.03.2018	Maire Tecnimont S.p.A.	Kauf	-	0.751534
15.03.2018	Mota-Engil SGPS SA	Rebalancing	1.236312	1.182120
15.03.2018	NH Hoteles SA	Rebalancing	0.694789	0.694138
15.03.2018	Novabase SGPS	Rebalancing	1.494368	1.489777
15.03.2018	Promotora de Informaciones SA	Rebalancing	1.546045	1.575906
15.03.2018	Prysmian SpA	Kauf	-	0.113976
15.03.2018	Sacyr S.A.	Rebalancing	1.903014	1.939126
15.03.2018	Sonae SGPS SA	Rebalancing	4.720888	4.625944
15.03.2018	Telecom Italia SPA	Rebalancing	6.857232	6.893919
15.03.2018	Unicredit SpA	Rebalancing	0.238155	0.241182
15.03.2018	Unieuro S.p.A.	Rebalancing	0.199847	0.209360
15.03.2018	Unione di Banche Italiane ScpA	Rebalancing	0.796572	0.810284
15.03.2018	Yoox SpA	Verkauf	0.108677	-
26.03.2018	Anima Holding S.p.A.	Rights Issue vom 26.03.2018	Anzahl Aktien alt 0.519517	Anzahl Aktien neu 0.548281
		Rebalancing vom 15.06.2018	Bestand alt	Bestand neu
15.06.2018	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	Rebalancing	0.094239	0.093962
15.06.2018	Almirall SA	Rebalancing	0.266726	0.273877
15.06.2018	Anima Holding S.p.A.	Rebalancing	0.548281	0.560016
15.06.2018	ArcelorMittal SA	Rebalancing	0.155576	0.152963
15.06.2018	Assicurazioni Generali SPA	Rebalancing	0.190529	0.199837
15.06.2018	Autogrill SpA	Kauf	-	0.329243
15.06.2018	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Rebalancing	0.495595	0.504382
15.06.2018	Banco de Sabadell SA	Rebalancing	2.366592	2.472200
15.06.2018	Banco Santander SA	Rebalancing	0.718907	0.849329
15.06.2018	Beni Stabili Spa SIIQ	Verkauf	5.541416	-
15.06.2018	Cairo Communication SPA	Rebalancing	1.176010	1.139254
15.06.2018	Cellnex Telecom S.A.	Rebalancing	0.136819	0.136590
15.06.2018	Cerved Group S.p.A.	Kauf	-	0.386437
15.06.2018	CIR Compagnie Industriali Riunite SpA	Rebalancing	2.563999	2.725070
15.06.2018	Distribuidora Internacional de Alimentacion	Rebalancing	0.893607	1.326247
15.06.2018	Ebro Foods SA	Rebalancing	0.163921	0.162134
15.06.2018	EMAK SPA	Rebalancing	2.348766	2.276952
15.06.2018	Grupo Ezentis SA	Rebalancing	4.782484	4.458600
15.06.2018	International Consolidated Airlines Group SA	Rebalancing	0.591492	0.565381
15.06.2018	Intesa Sanpaolo SpA	Rebalancing	1.376143	1.474720
15.06.2018	Liberbank SA	Rebalancing	7.900420	7.667741
15.06.2018	Maire Tecnimont S.p.A.	Rebalancing	0.751534	0.737382
15.06.2018	Mota-Engil SGPS SA	Rebalancing	1.182120	1.227993
15.06.2018	NH Hoteles SA	Rebalancing	0.694138	0.706344
15.06.2018	Novabase SGPS	Rebalancing	1.489777	1.547042
15.06.2018	Promotora de Informaciones SA	Rebalancing	1.575906	1.617639
15.06.2018	Prysmian SpA	Rebalancing	0.113976	0.112561
15.06.2018	Sacyr S.A.	Rebalancing	1.939126	1.912169
15.06.2018	Sonae SGPS SA	Rebalancing	4.625944	3.606411
15.06.2018	Telecom Italia SPA	Rebalancing	6.893919	7.096060
15.06.2018	Unicredit SpA	Rebalancing	0.241182	0.253091
15.06.2018	Unieuro S.p.A.	Verkauf	0.209360	-
15.06.2018	Unione di Banche Italiane ScpA	Rebalancing	0.810284	0.870629
02.07.2018	Prysmian SpA	Rights Issue vom 02.07.2018	Anzahl Aktien alt 0.112561	Anzahl Aktien neu 0.116427
		Rebalancing vom 17.09.2018	Bestand alt	Bestand neu
17.09.2018	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	Rebalancing	0.093962	0.095296
17.09.2018	Almirall SA	Rebalancing	0.273877	0.129032
17.09.2018	Anima Holding S.p.A.	Rebalancing	0.560016	0.508011
17.09.2018	ArcelorMittal SA	Rebalancing	0.152963	0.158204
17.09.2018	Assicurazioni Generali SPA	Rebalancing	0.199837	0.193004
17.09.2018	Autogrill SpA	Rebalancing	0.329243	0.333932
17.09.2018	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Rebalancing	0.504382	0.501104
17.09.2018	Banco de Sabadell SA	Rebalancing	2.472200	2.390308
17.09.2018	Banco Santander SA	Rebalancing	0.849329	0.861955
17.09.2018	Cairo Communication SPA	Rebalancing	1.139254	1.165196
17.09.2018	Cellnex Telecom S.A.	Rebalancing	0.136590	0.138920
17.09.2018	Cerved Group S.p.A.	Rebalancing	0.386437	0.383571

Kapitalereignisübersicht

Datum	Basiswert	Ereignis		
17.09.2018	CIR Compagnie Industriali Riunite SpA	Rebalancing	2.725070	2.724571
17.09.2018	Distribuidora Internacional de Alimentacion	Rebalancing	1.326247	1.537091
17.09.2018	Ebro Foods SA	Rebalancing	0.162134	0.162670
17.09.2018	EMAK SPA	Verkauf	2.276952	-
17.09.2018	Grupo Ezentis SA	Rebalancing	4.458600	4.631272
17.09.2018	International Consolidated Airlines Group SA	Rebalancing	0.565381	0.587384
17.09.2018	Intesa Sanpaolo SpA	Rebalancing	1.474720	1.338696
17.09.2018	Liberbank SA	Rebalancing	7.667741	7.501326
17.09.2018	Maire Tecnimont S.p.A.	Rebalancing	0.737382	0.737872
17.09.2018	Mota-Engil SGPS SA	Rebalancing	1.227993	1.540108
17.09.2018	NH Hoteles SA	Rebalancing	0.706344	0.725156
17.09.2018	Novabase SGPS	Rebalancing	1.547042	1.588082
17.09.2018	Promotora de Informaciones SA	Rebalancing	1.617639	1.641184
17.09.2018	Prysmian SpA	Rebalancing	0.116427	0.122693
17.09.2018	Sacyr S.A.	Rebalancing	1.912169	1.450351
17.09.2018	Safilo Group SpA	Kauf	-	1.095730
17.09.2018	Sonae SGPS SA	Rebalancing	3.606411	3.702916
17.09.2018	Telecom Italia SPA	Rebalancing	7.096060	7.267285
17.09.2018	Telepizza Group S.A.	Kauf	-	0.632606
17.09.2018	Unicredit SpA	Rebalancing	0.253091	0.237659
17.09.2018	Unione di Banche Italiane ScpA	Rebalancing	0.870629	0.763622
31.10.2018	NH Hoteles SA	Übernahme von NH Hoteles SA durch MHG Continental Holding vom 08.10.2018	Anzahl Aktien alt 0.725156	Anzahl Aktien neu 0
31.10.2018	EUR Cash	Erhöhung Cashanteil aufgrund Übernahme von NH Hoteles SA durch MHG Continental Holding vom 08.10.2018	Bestand alt 0	Bestand neu 4.568483
03.12.2018	Safilo Group SpA	Rights Issue vom 03.12.2018	Anzahl Aktien alt 1.095730	Anzahl Aktien neu 1.771192
		Rebalancing vom 17.12.2018	Bestand alt	Bestand neu
17.12.2018	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	Rebalancing	0.095296	0.091892
17.12.2018	Almirall SA	Rebalancing	0.129032	0.131887
17.12.2018	Anima Holding S.p.A.	Rebalancing	0.508011	0.527065
17.12.2018	ArcelorMittal SA	Rebalancing	0.158204	0.155656
17.12.2018	Assicurazioni Generali SPA	Rebalancing	0.193004	0.190727
17.12.2018	Autogrill SpA	Rebalancing	0.333932	0.362860
17.12.2018	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Rebalancing	0.501104	0.513160
17.12.2018	Banco de Sabadell SA	Rebalancing	2.390308	2.384473
17.12.2018	Banco Santander SA	Rebalancing	0.861955	0.852304
17.12.2018	Cairo Communication SPA	Rebalancing	1.165196	1.158350
17.12.2018	Cash EUR	Verkauf	4.568483	-
17.12.2018	Cellnex Telecom S.A.	Rebalancing	0.138920	0.136123
17.12.2018	Cerved Group S.p.A.	Rebalancing	0.383571	0.363490
17.12.2018	CIR Compagnie Industriali Riunite SpA	Rebalancing	2.724571	2.591924
17.12.2018	Distribuidora Internacional de Alimentacion	Rebalancing	1.537091	2.060630
17.12.2018	Ebro Foods SA	Rebalancing	0.162670	0.160232
17.12.2018	Grupo Ezentis SA	Rebalancing	4.631272	5.006331
17.12.2018	International Consolidated Airlines Group SA	Rebalancing	0.587384	0.597569
17.12.2018	Intesa Sanpaolo SpA	Rebalancing	1.338696	1.302804
17.12.2018	Liberbank SA	Rebalancing	7.501326	6.832325
17.12.2018	Maire Tecnimont S.p.A.	Rebalancing	0.737872	0.781017
17.12.2018	Mota-Engil SGPS SA	Rebalancing	1.540108	1.560475
17.12.2018	Novabase SGPS	Rebalancing	1.588082	1.589647
17.12.2018	Promotora de Informaciones SA	Rebalancing	1.641184	1.605348
17.12.2018	Prysmian SpA	Rebalancing	0.122693	0.113010
17.12.2018	Red Electrica Corporacion SA	Kauf	-	0.107537
17.12.2018	REN - Redes Energeticas Nacionales SGPS SA	Kauf	-	0.878040
17.12.2018	Sacyr S.A.	Rebalancing	1.450351	1.741440
17.12.2018	Safilo Group SpA	Rebalancing	1.771192	2.153748
17.12.2018	Sonae SGPS SA	Rebalancing	3.702916	3.664695
17.12.2018	Telecom Italia SPA	Rebalancing	7.267285	7.091791
17.12.2018	Telepizza Group S.A.	Rebalancing	0.632606	0.576944
17.12.2018	Unicredit SpA	Rebalancing	0.237659	0.242484
17.12.2018	Unione di Banche Italiane ScpA	Rebalancing	0.763622	0.807035
04.03.2019	Cellnex Telecom S.A.	Rights Issue vom 04.03.2019	Anzahl Aktien alt 0.136123	Anzahl Aktien neu 0.144544
		Rebalancing vom 15.03.2019	Bestand alt	Bestand neu

Kapitalereignisübersicht

Datum	Basiswert	Ereignis		
15.03.2019	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	Rebalancing	0.091892	0.093628
15.03.2019	Almirall SA	Rebalancing	0.131887	0.192961
15.03.2019	Anima Holding S.p.A.	Rebalancing	0.527065	0.534263
15.03.2019	ArcelorMittal SA	Rebalancing	0.155656	0.159372
15.03.2019	Assicurazioni Generali SPA	Rebalancing	0.190727	0.187178
15.03.2019	Autogrill SpA	Rebalancing	0.362860	0.336616
15.03.2019	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Rebalancing	0.513160	0.511803
15.03.2019	Banco de Sabadell SA	Rebalancing	2.384473	2.432227
15.03.2019	Banco Santander SA	Rebalancing	0.852304	0.856626
15.03.2019	Cairo Communication SPA	Rebalancing	1.158350	0.722805
15.03.2019	Cellnex Telecom S.A.	Rebalancing	0.144544	0.146984
15.03.2019	Cerved Group S.p.A.	Rebalancing	0.363490	0.349971
15.03.2019	CIR Compagnie Industriali Riunite SpA	Rebalancing	2.591924	2.528633
15.03.2019	Distribuidora Internacional de Alimentacion	Rebalancing	2.060630	2.096310
15.03.2019	Ebro Foods SA	Rebalancing	0.160232	0.161778
15.03.2019	Grupo Ezentis SA	Rebalancing	5.006331	4.964067
15.03.2019	International Consolidated Airlines Group SA	Rebalancing	0.597569	0.590656
15.03.2019	Intesa Sanpaolo SpA	Rebalancing	1.302804	1.297158
15.03.2019	Jeronimo Martins SGPS SA	Kauf	-	0.184814
15.03.2019	Liberbank SA	Rebalancing	6.832325	7.033614
15.03.2019	Maire Tecnimont S.p.A.	Rebalancing	0.781017	0.812578
15.03.2019	Mota-Engil SGPS SA	Rebalancing	1.560475	1.541371
15.03.2019	Novabase SGPS	Rebalancing	1.589647	1.147241
15.03.2019	Promotora de Informaciones SA	Rebalancing	1.605348	1.611499
15.03.2019	Prysmian SpA	Rebalancing	0.113010	0.112815
15.03.2019	Red Electrica Corporacion SA	Rebalancing	0.107537	0.149902
15.03.2019	REN - Redes Energeticas Nacionales SGPS SA	Rebalancing	0.878040	0.886261
15.03.2019	Sacyr S.A.	Rebalancing	1.741440	1.242597
15.03.2019	Safilo Group SpA	Rebalancing	2.153748	2.305791
15.03.2019	Sonae SGPS SA	Rebalancing	3.664695	3.659482
15.03.2019	Telecom Italia SPA	Rebalancing	7.091791	7.018985
15.03.2019	Telepizza Group S.A.	Rebalancing	0.576944	0.582009
15.03.2019	Unicredit SpA	Rebalancing	0.242484	0.241968
15.03.2019	Unione di Banche Italiane ScpA	Rebalancing	0.807035	0.805899
25.03.2019	Promotora de Informaciones SA	Rights Issue vom 25.03.2019	Anzahl Aktien alt 1.611499	Anzahl Aktien neu 1.703307
		Rebalancing vom 17.06.2019	Bestand alt 0.093628	Bestand neu 0.073792
17.06.2019	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	Rebalancing	0.093628	0.073792
17.06.2019	Almirall SA	Rebalancing	0.192961	0.193638
17.06.2019	Anima Holding S.p.A.	Verkauf	0.534263	-
17.06.2019	ArcelorMittal SA	Rebalancing	0.159372	0.189659
17.06.2019	Assicurazioni Generali SPA	Rebalancing	0.187178	0.190405
17.06.2019	Autogrill SpA	Rebalancing	0.336616	0.332436
17.06.2019	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Rebalancing	0.511803	0.523140
17.06.2019	Banco de Sabadell SA	Rebalancing	2.432227	2.975097
17.06.2019	Banco Santander SA	Rebalancing	0.856626	0.693715
17.06.2019	Cairo Communication SPA	Rebalancing	0.722805	1.014658
17.06.2019	Cellnex Telecom S.A.	Rebalancing	0.146984	0.085781
17.06.2019	Cerved Group S.p.A.	Rebalancing	0.349971	0.358806
17.06.2019	CIR Compagnie Industriali Riunite SpA	Rebalancing	2.528633	2.683227
17.06.2019	Distribuidora Internacional de Alimentacion	Verkauf	2.096310	-
17.06.2019	Ebro Foods SA	Rebalancing	0.161778	0.160654
17.06.2019	ENEL SpA	Kauf	-	0.453175
17.06.2019	Grupo Ezentis SA	Rebalancing	4.964067	5.027538
17.06.2019	Iberdrola SA	Kauf	-	0.308406
17.06.2019	Industria de Diseno Textil SA	Kauf	-	0.109773
17.06.2019	International Consolidated Airlines Group SA	Rebalancing	0.590656	0.585510
17.06.2019	Intesa Sanpaolo SpA	Rebalancing	1.297158	1.397217
17.06.2019	Jeronimo Martins SGPS SA	Rebalancing	0.184814	0.179610
17.06.2019	Liberbank SA	Rebalancing	7.033614	8.007850

Kapitalereignisübersicht

Datum	Basiswert	Ereignis		
17.06.2019	Maire Tecnimont S.p.A.	Rebalancing	0.812578	0.974207
17.06.2019	Mota-Engil SGPS SA	Rebalancing	1.541371	1.471270
17.06.2019	Novabase SGPS	Rebalancing	1.147241	1.233865
17.06.2019	Promotora de Informaciones SA	Rebalancing	1.703307	1.761865
17.06.2019	Prysmian SpA	Rebalancing	0.112815	0.162315
17.06.2019	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SPA	Kauf	-	0.074315
17.06.2019	Red Electrica Corporacion SA	Rebalancing	0.149902	0.147651
17.06.2019	REN - Redes Energeticas Nacionales SGPS SA	Rebalancing	0.886261	1.109354
17.06.2019	Sacyr S.A.	Verkauf	1.242597	-
17.06.2019	Safilo Group SpA	Verkauf	2.305791	-
17.06.2019	Sonae SGPS SA	Rebalancing	3.659482	3.129831
17.06.2019	Telecom Italia SPA	Rebalancing	7.018985	6.766438
17.06.2019	Telepizza Group S.A.	Rebalancing	0.582009	0.458591
17.06.2019	Unicredit SpA	Rebalancing	0.241968	0.247993
17.06.2019	Unione di Banche Italiane ScpA	Verkauf	0.805899	-
11.10.2019	Cellnex Telecom S.A.	Rights Issue vom 11.10.2019	Anzahl Aktien alt 0.085884	Anzahl Aktien neu 0.091765