

Tresides Commodity One Halbjahresbericht

31.03.2016

Vermögensübersicht

Aufteilung des Fondsvermögens nach Assetklassen

Assetklasse	Betrag	Anteil in %
I. Vermögensgegenstände	46.527.430,93	100,14
1. Anleihen	34.815.615,51	74,94
Verzinsliche Wertpapiere	34.815.615,51	74,94
2. Derivate	-59.301,26	-0,13
Swaps	-59.301,26	-0,13
3. Forderungen	259.479,52	0,56
4. Kurzfristig liquidierbare Anlagen	5.599.813,36	12,05
Tagesgelder	5.599.813,36	12,05
5. Bankguthaben	5.911.823,80	12,72
II. Verbindlichkeiten	-67.065,24	-0,14
Sonstige Verbindlichkeiten	-67.065,24	-0,14
III. Fondsvermögen	46.460.365,69	100,00

Vermögensaufstellung

31.03.2016

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	im Berichtszeitraum		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge			
Börsengehandelte Wertpapiere						34.417.088,31	74,08
Verzinsliche Wertpapiere						34.417.088,31	74,08
EUR						34.417.088,31	74,08
<i>Pfandbriefe / Kommunalobligationen</i>						23.026.673,51	49,57
1,125% Aktia Bank MTN 2013(18) XS0946639381	EUR	1.000.000	1.000.000	0	102,7778 %	1.027.778,40	2,21
1,375% Australia & N. Z. Bkg Grp EO-MT Cov. Bds 2013(18) XS0968449057	EUR	1.000.000	1.000.000	0	103,4462 %	1.034.462,30	2,23
1,500% Banco Santander Totta EO-MT Obr. Hip. 2014(17) PTBSQDOE0020	EUR	200.000	0	0	101,4614 %	202.922,70	0,44
0,100% Bank of Montreal EO-MT Mortg.Cov.Bds 2016(19) XS1344742892	EUR	1.000.000	1.000.000	0	100,2675 %	1.002.675,00	2,16
0,100% Bank of Nova Scotia EO-MT Mortg.Cov.Bds 2016(19) XS1346816322	EUR	1.000.000	1.000.000	0	100,3720 %	1.003.720,00	2,16
2,250% Barclays Bank EO-Mortg.Cov.MT Bds 2012(17) XS0748955142	EUR	250.000	0	0	102,0520 %	255.130,00	0,55
1,250% BELFIUS BANK 2012(17) BE0002419910	EUR	1.000.000	500.000	0	102,2255 %	1.022.255,40	2,20
3,125% BNP Paribas Public Sector SCF EO-MT Obl. 2011(16) FR0011059930	EUR	1.000.000	750.000	0	100,5730 %	1.005.730,00	2,16
4,250% Caixabank EO-Cédulas Hip. 2006(17) ES0414970295	EUR	500.000	250.000	0	103,4346 %	517.173,08	1,11
1,250% Canadian Imperial Bk of Comm. EO-MT Cov. Bds 2013(18) XS0958742313	EUR	1.000.000	1.000.000	0	103,1461 %	1.031.460,50	2,22
0,125% Cie de Financement Foncier EO-MT Obl. 2015(18) FR0012790319	EUR	1.000.000	300.000	0	100,5587 %	1.005.587,30	2,16

Tresides Commodity One

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
2,625% Commonwealth Bank of Australia EO-Mortg.Cov.MTN 2012(17) XS0729014281	EUR	1.000.000	1.000.000	0	102,0965 %	1.020.965,00	2,20
2,125% Credit Suisse (Guernsey Br.) EO-MT-HPF 2012(17) XS0732551550	EUR	1.000.000	1.000.000	0	101,7110 %	1.017.110,00	2,19
3,500% Danske Bank EO-MT Cov.Bds 2010(18) XS0501663099	EUR	500.000	0	0	107,4157 %	537.078,73	1,16
0,051% Deutsche Bank FLR-MTN-HPF 2012(19) DE000DB7XPM3	EUR	500.000	0	0	100,1665 %	500.832,71	1,08
0,000% DNB Boligkredit EO-FLR MT PF 2014(21) XS1137512742	EUR	500.000	0	0	100,2065 %	501.032,50	1,08
2,500% DNB Boligkredit EO-MT PF 2011(16) XS0691355282	EUR	500.000	0	0	101,4445 %	507.222,50	1,09
2,250% Eika Boligkredit EO-MT Cov. Nts 2012(17) XS0736417642	EUR	1.000.000	1.000.000	0	101,8725 %	1.018.725,00	2,19
3,250% Intesa Sanpaolo EO-MT HPF 2012(17) IT0004839251	EUR	800.000	800.000	0	103,4813 %	827.850,64	1,78
0,875% KBC Bank EO-MT Mortg.Cov.Bds 2013(16) BE0002441161	EUR	1.000.000	700.000	0	100,3870 %	1.003.870,00	2,16
3,000% Kutxabank EO-Cédulas Hipotec. 2013(17) ES0443307014	EUR	1.000.000	700.000	0	102,4828 %	1.024.828,15	2,21
1,250% National Bank of Canada EO-MT Cov. Bds 2013(18) XS1004892953	EUR	1.000.000	1.000.000	0	103,5318 %	1.035.318,35	2,23
1,375% Nordea Bank Finland EO-Cov. MTN 2013(18) XS0965104978	EUR	1.000.000	750.000	0	103,6600 %	1.036.599,80	2,23
1,000% Stadshypotek EO-Mortg. Covered MTN 2013(18) XS0906516256	EUR	1.000.000	1.000.000	0	102,4951 %	1.024.951,35	2,21
2,250% UBS (London Branch) EO-MT HPF 2012(17) XS0728789578	EUR	1.000.000	1.000.000	0	101,7650 %	1.017.650,00	2,19
1,250% UniCredit Bank Austria EO-MT HPF 2013(18) AT000B049390	EUR	1.000.000	1.000.000	0	103,0260 %	1.030.260,10	2,22
3,625% Unione di Banche Italiane EO-Mtg.Cov. MTN 2009(16) IT0004533896	EUR	800.000	800.000	0	101,6855 %	813.484,00	1,75

Tresides Commodity One

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	Käufe/ Zugänge		Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum						
Schuldverschreibungen der Kreditwirtschaft								6.687.750,20	14,39
0,107% Coöperatieve Rabobank U.A. EO-FLR MTN 2015(17) XS1304446013	EUR	800.000	800.000	0	100,0817	%	800.653,60	1,72	
0,340% DekaBank Dt.Girozentrale FLR-MTN-IHS 2016(18) XS1354256643	EUR	800.000	800.000	0	100,3855	%	803.084,00	1,73	
0,200% Dexia Crédit Local EO-MTN 2015(18) XS1268552061	EUR	1.000.000	500.000	200.000	100,6798	%	1.006.798,10	2,17	
1,500% Korea Development Bank EO-MTN 2013(18) XS0938197059	EUR	1.000.000	1.000.000	0	102,8495	%	1.028.495,00	2,21	
0,000% Nederlandse Waterschapsbank EO-FLR MTN 2012(18) XS0850783134	EUR	1.000.000	1.000.000	0	100,5830	%	1.005.830,00	2,17	
1,250% NRW.BANK MTN-IHS 2013(18) DE000NWB0535	EUR	1.000.000	1.000.000	0	103,8377	%	1.038.376,65	2,23	
0,125% SpareBank 1 Boligkredit EO-MT Mortg.Cov.Bds 2015(18) XS1320110791	EUR	1.000.000	1.500.000	500.000	100,4513	%	1.004.512,85	2,16	
Andere Schuldverschreibungen / Industrie								4.702.664,60	10,12
5,500% Alliander EO-MTN 2009(16) XS0423530350	EUR	500.000	500.000	0	100,2355	%	501.177,50	1,08	
0,058% BMW US Capital EO-FLR MTN 2015(18) DE000A1ZZ002	EUR	400.000	0	0	99,7347	%	398.938,80	0,86	
0,150% BMW US Capital EO-FLR MTN 2015(19) DE000A1Z6M04	EUR	300.000	0	0	99,5690	%	298.707,00	0,64	
0,154% Deutsche Bahn Finance EO-FLR MTN 2014(20) XS1089831249	EUR	400.000	0	0	100,5092	%	402.036,80	0,86	
4,375% Robert Bosch GmbH Anleihe 2006(16) XS0254720633	EUR	800.000	800.000	0	100,5165	%	804.132,00	1,73	
0,009% Sanofi EO-FLR MTN 2014(18) FR0012146751	EUR	400.000	0	0	99,9648	%	399.859,20	0,86	
0,065% Sanofi EO-FLR MTN 2015(19) FR0012969012	EUR	300.000	0	0	100,0935	%	300.280,50	0,65	
0,066% Total Capital Intl EO-FLR MTN 2014(20) XS1139316555	EUR	400.000	0	0	99,4068	%	397.627,20	0,86	

Tresides Commodity One

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum				
0,058% Toyota Motor Credit EO-FLR MTN 2015(18) XS1171489476	EUR	400.000	0	0	99,7690 %	399.076,00	0,86
0,000% Unilever EO-FLR MTN 2015(18) XS1241577060	EUR	800.000	400.000	0	100,1037 %	800.829,60	1,72
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						398.527,20	0,86
Verzinsliche Wertpapiere						398.527,20	0,86
EUR						398.527,20	0,86
Andere Schuldverschreibungen / Industrie						398.527,20	0,86
0,014% Coca-Cola Co. EO-FLR Notes 2015(19) XS1197832832	EUR	400.000	0	0	99,6318 %	398.527,20	0,86
Summe Wertpapiervermögen						34.815.615,51	74,94

Tresides Commodity One

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
im Berichtszeitraum							
Derivate							
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen							
handelt es sich um verkaufte Positionen.							
Swaps						-59.301,26	-0,13
Equity Swaps						-59.301,26	-0,13
(Zahlen/Erhalten)	Stück	52.400.000				-59.159,94	-0,13
EQS Performance Leg 29.03.16/07.04.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)							
EQS Credit Leg 29.03.16/07.04.16 US-Dollar 0,32%							
(Zahlen/Erhalten)	Stück	350.000				-141,32	0,00
EQS Performance Leg 30.03.16/07.04.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)							
EQS Credit Leg 30.03.16/07.04.16 US-Dollar 0,32%							
Forderungen						259.479,52	0,56
Zinsansprüche	EUR	259.479,52				259.479,52	0,56
Kurzfristig liquidierbare Anlagen						5.599.813,36	12,05
Tagesgelder						5.599.813,36	12,05
0,000% Südwestbank	EUR	5.599.813,36				5.599.813,36	12,05
Bankguthaben						5.911.823,80	12,72
Bankguthaben	EUR	4.466.902,50				4.466.902,50	9,61
Bankguthaben	USD	1.647.860,50				1.444.921,30	3,11
Verbindlichkeiten						-67.065,24	-0,14
Sonstige Verbindlichkeiten						-67.065,24	-0,14
Verwahrstellenvergütung	EUR	-2.936,55				-2.936,55	-0,01
Verwaltungsvergütung	EUR	-55.059,88				-55.059,88	-0,12

Tresides Commodity One

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.03.2016	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Fonds- vermögens
			im Berichtszeitraum				
Prüfungskosten	EUR	-4.000,00				-4.000,00	-0,01
Sonstige Verbindlichkeit	EUR	-4.593,91				-4.593,91	-0,01
Veröffentlichungskosten	EUR	-474,90				-474,90	0,00
Fondsvermögen					EUR	46.460.365,69	100,00*
Anteilwert					EUR	81,46	
Umlaufende Anteile					Stück	570.365	

* Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügig Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge		
		im Berichtszeitraum			
Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:					
Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheinanleihen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)					
Börsengehandelte Wertpapiere					
Verzinsliche Wertpapiere					
2,000% Aareal Bank MTN-HPF 2012(16) DE000AAR0124	EUR	1.000.000	1.000.000		
3,250% Banco Bilbao Vizcaya Arg. EO-Cédulas Hip. 2006(16) ES0413211113	EUR	300.000	800.000		
0,250% Bank of Nova Scotia EO-Covered MT Bds 2014(17) XS1132503308	EUR	1.000.000	1.000.000		
3,875% Bankinter EO-Cédulas Hipotec. 2012(15) ES0413679202	EUR	0	500.000		
2,250% Deutsche Pfandbriefbank MTN-HPF 2012(16) DE000A1K0RS7	EUR	0	250.000		
1,250% SpareBank 1 Boligkredit EO-MT Cov.Nts 2012(18) XS0820929437	EUR	1.000.000	1.000.000		
3,125% Sparebanken Vest Boligkred. EO-MT HPF 2011(16) XS0589450211	EUR	0	500.000		
2,625% UniCredit EO-Covered MTN 2010(15) IT0004638737	EUR	0	500.000		
0,099% Volkswagen Leasing FLR-MTN 2015(17) XS1273542867	EUR	0	600.000		

Tresides Commodity One

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	im Berichtszeitraum		Volumen in 1.000
		Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	
Swaps				
Equity-Swaps				
(Erhalten/Zahlen)	USD	600.000	0	643.956
EQS Credit Leg 06.11.15/17.11.15US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 06.11.15/17.11.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
(Erhalten/Zahlen)	USD	200.000	0	214.864
EQS Credit Leg 10.11.15/17.11.15US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 10.11.15/17.11.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
(Zahlen/Erhalten)	USD	100.000	0	110.412
EQS Performance Leg 26.10.15/05.11.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 26.10.15/05.11.15 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	50.000	0	568.865
EQS Performance Leg 12.10.15/19.10.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 12.10.15/19.10.15 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	100.000	0	109.705
EQS Performance Leg 08.12.15/15.12.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 08.12.15/15.12.15 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	600.000	0	6.558
EQS Performance Leg 03.12.15/15.12.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 03.12.15/15.12.15 US-Dollar 0,32%				

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	
		im Berichtszeitraum		
Erhalten/Zahlen)	USD	300.000	0	321.165
EQS Credit Leg 18.11.15/02.12.15 US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 18.11.15/02.12.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
(Zahlen/Erhalten)	USD	250.000	0	2.748.125
EQS Performance Leg 11.12.15/15.12.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 11.12.15/15.12.15 US-Dollar 0,32%				
Erhalten/Zahlen)	USD	200.000	0	22.631
EQS Credit Leg 16.03.16/29.03.16US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 16.03.16/29.03.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
Erhalten/Zahlen)	USD	100.000	0	108.491
EQS Credit Leg 11.01.16/25.01.16 US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 11.01.16/25.01.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
(Zahlen/Erhalten)	USD	500.000	0	543.595
EQS Performance Leg 07.01.16/08.01.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 07.01.16/08.01.16US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	300.000	0	328.974
EQS Performance Leg 21.12.15/08.01.16US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 21.12.15/08.01.16 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	0	0	9.738.187
EQS Performance Leg 15.12.15/08.01.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 15.12.15/08.01.16 US-Dollar 0,32%				

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	
		im Berichtszeitraum		
(Zahlen/Erhalten)	USD	300.000	0	328.485
EQS Performance Leg 04.03.16/14.03.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 04.03.16/14.03.16 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	51.300.000	0	56.884.005
EQS Performance Leg 14.03.16/29.03.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 14.03.16/29.03.16 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	400.000	0	433.608
EQS Performance Leg 20.01.16/25.01.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 20.01.16/25.01.16 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	300.000	0	33.387
EQS Performance Leg 04.02.16/10.02.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 04.02.16/10.02.16 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	0	0	223.815
EQS Performance Leg 15.03.15/29.03.15US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 15.03.15/29.03.15US-Dollar 0,32%				
Erhalten/Zahlen)	USD	300.000	0	325.173
EQS Credit Leg 28.01.16/10.02.16US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 28.01.16/10.02.16US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
Erhalten/Zahlen)	USD	300.000	0	326.805
EQS Credit Leg 29.01.16/10.02.16US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 29.01.16/10.02.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	
		im Berichtszeitraum		
Erhalten/Zahlen)	USD	300.000	0	32.439
EQS Credit Leg 21.01.16/25.01.16 US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 21.01.16/25.01.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
Erhalten/Zahlen)	USD	100.000	0	108.395
EQS Credit Leg 01.03.16/03.03.16 US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 01.03.16/03.03.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
(Zahlen/Erhalten)	USD	300.000	0	326.997
EQS Performance Leg 15.01.16/25.01.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 15.01.16/25.01.16 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	300.000	0	337.755
EQS Performance Leg 18.03.16/29.03.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 18.03.16/29.03.16US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	300.000	0	328.701
EQS Performance Leg 14.12.15/15.12.15US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 14.12.15/15.12.15US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	1.600.000	0	175.416
EQS Performance Leg 08.03.16/14.03.16US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 08.03.16/14.03.16US-Dollar 0,32%				
Erhalten/Zahlen)	USD	600.000	0	67.221
EQS Credit Leg 24.03.16/29.03.16US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 24.03.16/29.03.16US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	
		im Berichtszeitraum		
(Zahlen/Erhalten)	USD	150.000	0	1.653.375
EQS Performance Leg 02.02.16/10.02.16US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 02.02.16/10.02.16US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	100.000	0	111.345
EQS Performance Leg 05.02.16/10.02.16US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 05.02.16/10.02.16US-Dollar 0,32%				
Erhalten/Zahlen)	USD	100.000	0	110.495
EQS Credit Leg 09.03.16/14.03.16US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 09.03.16/14.03.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
(Zahlen/Erhalten)	USD	45.900.000	0	51.942.735
EQS Performance Leg 10.02.16/22.02.16US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 10.02.16/22.02.16US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	200.000	0	21.861
EQS Performance Leg 01.02.16/10.02.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 01.02.16/10.02.16 US-Dollar 0,32%				
Erhalten/Zahlen)	USD	200.000	0	22.031
EQS Credit Leg 23.02.16/03.03.16US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 23.02.16/03.03.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
Erhalten/Zahlen)	USD	100.000	0	108.494
EQS Credit Leg 12.01.16/25.01.16US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 12.01.16/25.01.16US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	
		im Berichtszeitraum		
Erhalten/Zahlen)	USD	200.000	0	214.994
EQS Credit Leg 04.01.16/08.01.16US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 04.01.16/08.01.16US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
Erhalten/Zahlen)	USD	250.000	0	273.225
EQS Credit Leg 23.12.15/08.01.16US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 23.12.15/08.01.16US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
Erhalten/Zahlen)	USD	200.000	0	22.289
EQS Credit Leg 12.02.16/22.02.16US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 12.02.16/22.02.16US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
(Zahlen/Erhalten)	USD	600.000	0	662.094
EQS Performance Leg 30.10.15/05.11.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 30.10.15/05.11.15 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	700.000	0	757.358
EQS Performance Leg 04.12.15/15.12.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 04.12.15/15.12.15 US-Dollar 0,32%				
Erhalten/Zahlen)	USD	300.000	0	326.835
EQS Credit Leg 03.11.15/05.11.15 US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 03.11.15/05.11.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
(Zahlen/Erhalten)	USD	400.000	0	429.488
EQS Performance Leg 12.11.15/17.11.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 12.11.15/17.11.15 US-Dollar 0,32%				

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	
		im Berichtszeitraum		
(Zahlen/Erhalten)	USD	50.000	0	568.585
EQS Performance Leg 09.10.15/19.10.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 09.10.15/19.10.15 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	100.000	0	109.424
EQS Performance Leg 02.11.15/05.11.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 02.11.15/05.11.15 US-Dollar 0,32%				
Erhalten/Zahlen)	USD	600.000	0	662.322
EQS Credit Leg 23.10.15/05.11.15 US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 23.10.15/05.11.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
(Zahlen/Erhalten)	USD	150.000	0	161.616
EQS Performance Leg 11.11.15/17.11.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 11.11.15/17.11.15 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	800.000	0	884.752
EQS Performance Leg 29.10.15/05.11.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 29.10.15/05.11.15 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	350.000	0	383.712
EQS Performance Leg 09.12.15/15.12.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 09.12.15/15.12.15 US-Dollar 0,32%				
Erhalten/Zahlen)	USD	0	0	11.189
EQS Credit Leg 06.11.15/17.11.15 US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 06.11.15/17.11.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	
		im Berichtszeitraum		
(Zahlen/Erhalten)	USD	8.600.000	0	9.757.904
EQS Performance Leg 20.10.15/05.11.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 20.10.15/05.11.15 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	100.000	0	112.128
EQS Performance Leg 02.10.15/07.10.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 02.10.15/07.10.15 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	8.000.000	0	912.968
EQS Performance Leg 13.10.15/19.10.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 13.10.15/19.10.15 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	43.300.000	0	46.190.275
EQS Performance Leg 17.11.15/02.12.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 17.11.15/02.12.15 US-Dollar 0,32%				
Erhalten/Zahlen)	USD	100.000	0	106.499
EQS Credit Leg 20.11.15/02.12.15 US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 20.11.15/02.12.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
(Zahlen/Erhalten)	USD	45.500.000	0	48.848.345
EQS Performance Leg 05.11.15/17.11.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 05.11.15/17.11.15 US-Dollar 0,32%				
Erhalten/Zahlen)	USD	150.000	0	165.297
EQS Credit Leg 10.12.15/15.12.15 US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 10.12.15/15.12.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	
		im Berichtszeitraum		
Erhalten/Zahlen)	USD	700.000	0	771.848
EQS Credit Leg 22.10.15/05.11.15 US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 22.10.15/05.11.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
(Zahlen/Erhalten)	USD	250.000	0	26.709
EQS Performance Leg 19.11.15/02.12.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 19.11.15/02.12.15 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	46.600.000	0	5.141.145
EQS Performance Leg 03.03.16/14.03.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 03.03.16/14.03.16 US-Dollar 0,32%				
Erhalten/Zahlen)	USD	400.000	0	430.008
EQS Credit Leg 05.01.16/08.01.16 US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 05.01.16/08.01.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
Erhalten/Zahlen)	USD	200.000	0	21.787
EQS Credit Leg 26.02.16/03.03.16 US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 26.02.16/03.03.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
(Zahlen/Erhalten)	USD	300.000	0	327.165
EQS Performance 22.12.15/08.01.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 22.12.15/08.01.16 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	200.000	0	22.531
EQS Performance Leg 11.02.16/22.02.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 11.02.16/22.02.16 US-Dollar 0,32%				

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	
		im Berichtszeitraum		
Erhalten/Zahlen)	USD	300.000	0	326.784
EQS Credit Leg 18.12.15/08.01.16 US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 18.12.15/08.01.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
(Zahlen/Erhalten)	USD	42.700.000	0	46.269.293
EQS Performance Leg 26.10.15/05.11.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 26.10.15/05.11.15 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	43.000.000	0	4.685.194
EQS Performance Leg 08.01.16/25.01.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 08.01.16/25.01.16 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	600.000	0	654.996
EQS Performance Leg 27.01.16/10.02.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 27.01.16/10.02.16 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	1.300.000	0	1.453.595
EQS Performance Leg 22.03.16/29.03.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 22.03.16/29.03.16 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	300.000	0	336.405
EQS Performance Leg 26.10.15/05.11.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 26.10.15/05.11.15 US-Dollar 0,32%				
Erhalten/Zahlen)	USD	300.000	0	333.675
EQS Credit Leg 16.02.16/22.02.16 US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 16.02.16/22.02.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				

Tresides Commodity One

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	
		im Berichtszeitraum		
(Zahlen/Erhalten)	USD	44.600.000	0	4.863.853
EQS Performance Leg 15.12.15/08.01.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 15.12.15/08.01.16 US-Dollar 0,32%				
Erhalten/Zahlen)	USD	100.000	0	11.102
EQS Credit Leg 18.02.16/22.02.16 US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 18.02.16/22.02.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
(Zahlen/Erhalten)	USD	46.000.000	0	50.623
EQS Performance Leg 22.02.16/03.03.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 22.02.16/03.03.16 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	600.000	0	67.773
EQS Performance Leg 17.03.16/29.03.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 17.03.16/29.03.16 US-Dollar 0,32%				
Erhalten/Zahlen)	USD	300.000	0	325.365
EQS Credit Leg 29.02.16/03.03.16 US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 29.02.16/03.03.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
Erhalten/Zahlen)	USD	100.000	0	109.275
EQS Credit Leg 02.03.16/03.03.16 US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 02.03.16/03.03.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
(Zahlen/Erhalten)	USD	100.000	0	113.155
EQS Performance Leg 15.03.16/29.03.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 15.03.16/29.03.16 US-Dollar 0,32%				

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	
		im Berichtszeitraum		
(Zahlen/Erhalten)	USD	0	0	11.911.306
EQS Performance Leg 29.03.16/07.04.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 29.03.16/07.04.16 US-Dollar 0,32%				
Erhalten/Zahlen)	USD	100.000	0	112.745
EQS Credit Leg 08.02.16/10.02.16 US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 08.02.16/10.02.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
(Zahlen/Erhalten)	USD	2.000.000	0	22.084
EQS Performance Leg 07.03.16/14.03.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 07.03.16/14.03.16 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	500.000	0	561.475
EQS Performance Leg 09.02.16/10.02.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 09.02.16/10.02.16 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	600.000	0	66.843
EQS Performance Leg 10.03.16/14.03.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 10.03.16/14.03.16 US-Dollar 0,32%				
Erhalten/Zahlen)	USD	200.000	0	21.779
EQS Credit Leg 26.01.16/10.02.16 US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 26.01.16/10.02.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
Erhalten/Zahlen)	USD	100.000	0	110.975
EQS Credit Leg 17.02.16/22.02.16 US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 17.02.16/22.02.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	
		im Berichtszeitraum		
Erhalten/Zahlen)	USD	150.000	0	162.747
EQS Credit Leg 16.12.15/08.01.16 US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 16.12.15/08.01.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
Erhalten/Zahlen)	USD	300.000	0	324.681
EQS Credit Leg 17.12.15/08.01.16 US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 17.12.15/08.01.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
(Zahlen/Erhalten)	USD	100.000	0	11.158
EQS Performance Leg 23.03.16/29.03.16 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 23.03.16/29.03.16 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	100.000	0	109.633
EQS Performance Leg 26.10.15/05.11.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 26.10.15/05.11.15 US-Dollar 0,32%				
Erhalten/Zahlen)	USD	200.000	0	211.656
EQS Credit Leg 25.11.15/02.12.15 US-Dollar 0,32%				
EQS Performance Leg 25.11.15/02.12.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
(Zahlen/Erhalten)	USD	7.800.000	0	8.705.502
EQS Performance Leg 21.10.15/05.11.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 21.10.15/05.11.15 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten)	USD	6.500.000	0	7.392.255
EQS Performance Leg 14.10.15/19.10.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
EQS Credit Leg 14.10.15/19.10.15 US-Dollar 0,32%				

Tresides Commodity One

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	
		im Berichtszeitraum		
Erhalten/Zahlen) EQS Credit Leg 07.12.15/15.12.15 US-Dollar 0,32%	USD	100.000	0	108.743
EQS Performance Leg 07.12.15/15.12.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
(Erhalten/Zahlen) EQS Performance Leg 02.12.15/15.12.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)	USD	43.100.000	0	46.548.431
EQS Credit Leg 02.12.15/15.12.15 US-Dollar 0,32%				
Erhalten/Zahlen) EQS Credit Leg 05.10.15/07.10.15 US-Dollar 0,32%	USD	100.000	0	112.184
EQS Performance Leg 05.10.15/07.10.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)				
(Zahlen/Erhalten) EQS Performance Leg 07.10.15/19.10.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)	USD	16.000.000	0	1.799.776
EQS Credit Leg 07.10.15/19.10.15 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten) EQS Performance Leg 01.12.15/02.12.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)	USD	200.000	0	211.552
EQS Credit Leg 01.12.15/02.12.15 US-Dollar 0,32%				
(Zahlen/Erhalten) EQS Performance Leg 19.10.15/05.11.15 US-Dollar UBS Comm.Quart.Backw.Select-12 Index (USD)	USD	30.700.000	0	34.844.193
EQS Credit Leg 19.10.15/05.11.15 US-Dollar 0,32%				

Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

Angaben nach der Derivateverordnung

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	74,94
Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)	-0,13

Sonstige Angaben

Anteilwert					EUR	81,46
Umlaufende Anteile					Stück	570.365

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Sondervermögens sind auf der Grundlage der Kapitalanlage-Rechnungslegungs- und Bewertungsverordnung mit nachstehenden Kursen/Marktsätzen bewertet:

Wertpapierart	Region	Bewertungsdatum	§27 Bewertung mit handelbaren Kursen	§28 Bewertung mit Bewertungsmodellen	§32 Besonderheiten bei der Bewertung unternehmerischer Beteiligungen	§29 Besonderheiten bei Investmentanteilen, Bankguthaben und Verbindlichkeiten
Renten						
	Inland	30.03.2016	5,69 %	1,08 %		
	Europa	30.03.2016	49,54 %			
	Asien	31.03.2016	2,21 %			
	Australien	30.03.2016	4,43 %			
	Nordamerika	30.03.2016	11,99 %			
Derivate - Swaps						
		30.03.2016	-0,13 %			
Übriges Vermögen						
		31.03.2016				25,19 %
			73,73 %	1,08 %		25,19 %

Die prozentualen Angaben beziehen sich auf den Anteil der einzelnen Vermögensgegenstände am Fondsvermögen.

Die Bewertung erfolgt durch die Verwahrstelle unter Mitwirkung der Kapitalverwaltungsgesellschaft. Die Bewertung von börsengehandelten Vermögensgegenständen erfolgt mit entsprechend handelbaren Kursen. Sollten für diese Vermögensgegenstände keine handelbaren Kurse verfügbar sein, erfolgt die Bewertung auf Basis geeigneter Modelle. Bewertungseinheiten werden nicht gebildet.

Devisenkurse

	per	31.03.2016		
US-Dollar	(USD)	1,140450	=	1 EUR

Frankfurt am Main, den 31. März 2016

BNY Mellon Service
Kapitalanlage-Gesellschaft mbH
Frankfurt am Main

(Geschäftsführung)