

Julius Bär

Merkmale regulatorischer Eigenkapitalinstrumente

Stand per 31. Dezember 2020

Die emittierten Instrumente werden in separaten Spalten tabellarisch dargestellt. Bei Abweichungen der tabellarischen und summarischen Darstellung der Instrumente im Vergleich zu deren Produktdokumentation, geht die jeweilige Produktdokumentation vor.

	Bond Tier 1 – 2016	Bond Tier 1 – 2017	Bond Tier 1 – 2019	Bond Tier 1 – 2020
Emittent	Julius Bär Gruppe AG			
Identifikation (z.B. ISIN)	XS1502435727	XS1679216801	CH0481013784	XS2238020445
Geltendes Recht des Instruments	Swiss Law	Swiss Law	Swiss Law	Swiss Law
Aufsichtsrechtliche Behandlung				
Berücksichtigung unter den Basel-III-Übergangsregelungen (CET1 / AT1 / T2)	AT1	AT1	AT1	AT1
Berücksichtigung nach der Basel-III-Übergangsphase (CET1 / AT1 / T2)	AT1	AT1	AT1	AT1
Anrechenbar auf Solo-/Konzern-/Solo- und Konzernebene	Konzern	Konzern	Konzern	Konzern
Beteiligungstitel / Schuldtitel / hybride Instrumente / sonstige Instrumente	Hybrid	Hybrid	Hybrid	Hybrid

	Bond Tier 1 – 2016	Bond Tier 1 – 2017	Bond Tier 1 – 2019	Bond Tier 1 – 2020
An regulatorisches Eigenkapital anrechenbarer Betrag (laut letztem Eigenmittelnachweis)	CHF 222m	CHF 265m	CHF 348m	CHF 303m
Nennwert des Instruments	SGD 325m	USD 300m	CHF 350m	USD 350m
Rechnungslegungsposition	CHF 222m	CHF 265m	CHF 348m	CHF 303m
Ursprüngliches Ausgabedatum	20.10.2016	12.09.2017	25.06.2019	29.09.2020
Unbegrenzt oder mit Verfalltermin	Unbegrenzt	Unbegrenzt	Unbegrenzt	Unbegrenzt
Ursprüngliches Fälligkeitsdatum	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
Durch Emittenten kündbar (mit vorheriger Zustimmung der Aufsichtsbehörde)	Ja	Ja	Ja	Ja
Wählbarer Kündigungstermin / bedingte Kündigungstermine / Tilgungsbetrag	Erstmalig am 20.04.2022 und an jedem darauffolgenden 20. April. Tilgung der Anleihe als Ganzes.	Erstmals am 12.09.2024 und an jedem halbjährlichen Zinszahlungstermin nach dem 12.09.2024. Tilgung der Anleihe als Ganzes.	Jederzeit drei Monate vor und am 25.09.2025 sowie an jedem darauffolgenden Zinszahlungstermin. Tilgung der Anleihe als Ganzes.	Erstmals am 08.10.2026 und an jedem halbjährlichen Zinszahlungstermin nach dem 08.10.2026. Tilgung der Anleihe als Ganzes.
Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
Coupons / Dividenden				
Fest / variabel / zuerst fest und dann variabel / zuerst variabel und dann fest	Zuerst fest und dann variabel	Zuerst fest und dann variabel	Zuerst fest und dann variabel	Zuerst fest und dann variabel
Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	5.75% (5-year SGD Swap Ask-rate)	4.75% (UST ¹ 1.875%)	2.375% (6.25-year mid-market swap rate) ²	4.875% (UST ³ 0.259%)

¹ Für die Preisfestsetzung wurde die 7-jährige US Treasury Rate verwendet. Im Falle einer Verlängerung würde die 5-jährige US Constant Maturity Treasury („CMT“) Rate angewendet.

² Für die Preisfestsetzung wurde die 6.25-jährige Mid-Market-Swap Rate verwendet. Im Falle einer Verlängerung zu einem Zeitpunkt, zu dem die 5-jährige-CHF Mid-Market Swap Rate eingestellt wurde, wird der Zinssatz mittels eines alternativen Benchmark-Satzes ermittelt, der mit der 5-jährigen CHF Mid-Market Swap Rate vergleichbar ist, wenn diese nicht eingestellt worden wäre.

³ Für die Preisfestsetzung wurde die 5-jährige US Treasury Rate verwendet. Im Falle einer Verlängerung würde die 5-jährige US Constant Maturity Treasury („CMT“) Rate angewendet.

	Bond Tier 1 – 2016	Bond Tier 1 – 2017	Bond Tier 1 – 2019	Bond Tier 1 – 2020
Bestehen eines „Dividenden-Stopps“ (Dividendenverzicht auf dem Instrument führt zu einer Aufhebung der Dividenden auf ordentliche Aktien)	Ja (kann durch Aktionäre übersteuert werden)			
Zinszahlungen bzw. Dividenden: völlig diskretionär / teilweise diskretionär / zwingend	Völlig diskretionär	Völlig diskretionär	Völlig diskretionär	Völlig diskretionär
Bestehen einer Zinserhöhungsklausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	Nein	Nein	Nein	Nein
Nicht kumulativ oder kumulativ	Nicht kumulativ	Nicht kumulativ	Nicht kumulativ	Nicht kumulativ
Wandelbar oder nicht wandelbar	Nicht kumulativ	Nicht kumulativ	Nicht kumulativ	Nicht kumulativ
Wenn wandelbar: Auslöser für die Wandlung (inkl. durch PONV)	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
Wenn wandelbar: ganz in jedem Fall / ganz oder teilweise / teilweise in jedem Fall	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
Wenn wandelbar: Wandlungsrate	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
Wenn wandelbar: Wandlung obligatorisch / fakultativ	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
Wenn wandelbar: Typ des Instruments, in das gewandelt wird	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
Wenn wandelbar: Emittent des Instruments, in das gewandelt wird	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.

	Bond Tier 1 – 2016	Bond Tier 1 – 2017	Bond Tier 1 – 2019	Bond Tier 1 – 2020
Abschreibungsmerkmal	Abschreibung im notwendigen Umfang um den “Trigger“ wieder zu erreichen. Totalabschreibung im Sanierungsfall.	Abschreibung im notwendigen Umfang um den “Trigger“ wieder zu erreichen. Totalabschreibung im Sanierungsfall.	Abschreibung im notwendigen Umfang um den “Trigger“ wieder zu erreichen. Totalabschreibung im Sanierungsfall.	Abschreibung im notwendigen Umfang um den “Trigger“ wieder zu erreichen. Totalabschreibung im Sanierungsfall.
Auslöser für die Abschreibung	Abschreibungsschwelle bei 7% CET1 oder im Sanierungsfall.	Abschreibungsschwelle bei 7% CET1 oder im Sanierungsfall.	Abschreibungsschwelle bei 5.125% CET1 oder im Sanierungsfall.	Abschreibungsschwelle bei 7% CET1 oder im Sanierungsfall.
Ganz/teilweise	Abhängig vom Auslöser	Abhängig vom Auslöser	Abhängig vom Auslöser	Abhängig vom Auslöser
Dauerhaft oder vorübergehend	dauerhaft	dauerhaft	dauerhaft	dauerhaft
Bei vorübergehender Abschreibung: Mechanismus der Zuschreibung	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	T2	T2	T2	T2
Existenz von Merkmalen, die eine volle Anerkennung unter Basel III verhindern	Nein	No	No	No
Wenn ja, diese nennen	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.