

## Merkmale regulatorischer Eigenkapitalinstrumente

Stand per 30. Juni 2022

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.

	<b>Bond Tier 1 – 2017</b>	<b>Bond Tier 1 – 2019</b>	<b>Bond Tier 1 – 2020</b>	<b>Bond Tier 1 - 2021</b>	<b>Bond Tier 1 – 2022</b>
Emittent	Julius Bär Gruppe AG				
Identifikation (z.B. ISIN)	XS1679216801	CH0481013784	XS2238020445	XS2387925501	XS2468403428
Geltendes Recht des Instruments	Swiss Law				
<b>Aufsichtsrechtliche Behandlung</b>					
Berücksichtigung unter den Basel-III-Übergangsregelungen (CET1 / AT1 / T2)	AT1	AT1	AT1	AT1	AT1
Berücksichtigung nach der Basel-III-Übergangsphase (CET1 / AT1 / T2)	AT1	AT1	AT1	AT1	AT1
Anrechenbar auf Solo-/Konzern-/Solo- und Konzernebene	Konzern	Konzern	Konzern	Konzern	Konzern
Beteiligungstitel / Schuldtitel / hybride Instrumente / sonstige Instrumente	Hybrid	Hybrid	Hybrid	Hybrid	Hybrid

	<b>Bond Tier 1 – 2017</b>	<b>Bond Tier 1 – 2019</b>	<b>Bond Tier 1 – 2020</b>	<b>Bond Tier 1 - 2021</b>	<b>Bond Tier 1 – 2022</b>
An regulatorisches Eigenkapital anrechenbarer Betrag	CHF 285m	CHF 349m	CHF 300m	CHF 304m	CHF 389m
Nennwert des Instruments	USD 300m	CHF 350m	USD 350m	USD 320m	USD 400m
Rechnungslegungsposition	CHF 285m	CHF 349m	CHF 300m	CHF 304m	CHF 389m
Ursprüngliches Ausgabedatum	12.09.2017	25.06.2019	08.10.2020	23.09.2021	09.06.2022
Unbegrenzt oder mit Verfalltermin	Unbegrenzt	Unbegrenzt	Unbegrenzt	Unbegrenzt	Unbegrenzt
Ursprüngliches Fälligkeitsdatum	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
Durch Emittenten kündbar (mit vorheriger Zustimmung der Aufsichtsbehörde)	Ja	Ja	Ja	Ja	Ja
Wählbarer Kündigungstermin / bedingte Kündigungstermine / Tilgungsbetrag	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.	Jederzeit in den sechs Monaten vor und am 08.10.2026 sowie an jedem darauffolgenden Zinszahlungstermin. Tilgung der Anleihe als Ganzes.	Jederzeit in den sechs Monaten vor und am 23.09.2028 sowie an jedem darauffolgenden Zinszahlungstermin. Tilgung der Anleihe als Ganzes.	Jederzeit in den sechs Monaten vor und am 09.12.2027 sowie an jedem darauffolgenden Zinszahlungstermin. Tilgung der Anleihe als Ganzes.
Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.

**Bond Tier 1 – 2017    Bond Tier 1 – 2019    Bond Tier 1 – 2020    Bond Tier 1 - 2021    Bond Tier 1 – 2022**

<b>Coupons / Dividenden</b>					
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	Zuerst fest und dann variabel
Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	4.75% (UST <sup>1</sup> 1.875%)	2.375% (6.25-year mid-market swap rate) <sup>2</sup>	4.875% (UST <sup>3</sup> 0.259%)	3.625% (UST <sup>1</sup> 1.086%)	6.875% (UST <sup>4</sup> 2.935%)
Bestehen eines „Dividenden-Stopps“ (Dividendenverzicht auf dem Instrument führt zu einer Aufhebung der Dividenden auf ordentliche Aktien)	Ja (kann durch Aktionäre übersteuert werden)	Ja (kann durch Aktionäre übersteuert werden)	Ja (kann durch Aktionäre übersteuert werden)	Ja (kann durch Aktionäre übersteuert werden)	Ja (kann durch Aktionäre übersteuert werden)
Zinszahlungen bzw. Dividenden: völlig diskretionär / teilweise diskretionär / zwingend	Völlig diskretionär	Völlig diskretionär	Völlig diskretionär	Völlig diskretionär	Völlig diskretionär
Bestehen einer Zinserhöhungsklausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> 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.

<sup>3</sup> 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.

<sup>4</sup> Für die Preisfestsetzung wurde die interpolierte 5.5-jährige US Treasury Rate verwendet. Im Falle einer Verlängerung würde die 5-jährige US Constant Maturity Treasury („CMT“) Rate angewendet

	<b>Bond Tier 1 – 2017</b>	<b>Bond Tier 1 – 2019</b>	<b>Bond Tier 1 – 2020</b>	<b>Bond Tier 1 - 2021</b>	<b>Bond Tier 1 – 2022</b>
Nicht kumulativ oder kumulativ	Nicht kumulativ	Nicht kumulativ	Nicht kumulativ	Nicht kumulativ	Nicht kumulativ
Wandelbar oder nicht wandelbar	Nicht kumulativ				
Wenn wandelbar: Auslöser für die Wandlung (inkl. durch PONV)	n.a.	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.	n.a.
Wenn wandelbar: Wandlungsrate	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
Wenn wandelbar: Wandlung obligatorisch / fakultativ	n.a.	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.	n.a.
Wenn wandelbar: Emittent des Instruments, in das gewandelt wird	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.

	<b>Bond Tier 1 – 2017</b>	<b>Bond Tier 1 – 2019</b>	<b>Bond Tier 1 – 2020</b>	<b>Bond Tier 1 - 2021</b>	<b>Bond Tier 1 – 2022</b>
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.	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 5.125% CET1 oder im Sanierungsfall.	Abschreibungsschwelle bei 7% CET1 oder im Sanierungsfall.	Abschreibungsschwelle bei 5.125% CET1 oder im Sanierungsfall.	Abschreibungsschwelle bei 5.125% CET1 oder im Sanierungsfall.
Ganz/teilweise	Abhängig vom Auslöser				
Dauerhaft oder vorübergehend	dauerhaft	dauerhaft	dauerhaft	dauerhaft	Dauerhaft
Bei vorübergehender Abschreibung: Mechanismus der Zuschreibung	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.
Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	T2	T2	T2	T2	T2
Existenz von Merkmalen, die eine volle Anerkennung unter Basel III verhindern	No	No	No	No	No
Wenn ja, diese nennen	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.