

Angaben zu Derivaten

ID-Code des Derivats	Art des ID-Codes des Derivats	Name der Gegenpartei	Code der Gegenpartei	Art des Codes der Gegenpartei	Externes Rating	Benannte ECAI	Bonitätsstufe	Internes Rating	Gegenpartei-gruppe	Code der Gegenpartei-gruppe	(Forts.)
C0040	C0050	C0260	C0270	C0280	C0290	C0300	C0310	C0320	C0330	C0340	

Art des Codes der Gegenpartei-gruppe	Bezeichnung des Kontrakts	Währung	CIC	Triggerwert	Auslöser für Kontraktauflösung	Bei einem Swap gezahlte Währung	Bei einem Swap vereinbarte Währung	Fälligkeits-termin
C0350	C0360	C0370	C0380	C0390	C0400	C0410	C0420	C0430

S.08.01.04

Offene Derivate

Angaben zu den gehaltenen Positionen

Einge-tragener Name des Unter-nehmens	Identifikati-onscode des Unternehmens	Art des ID-Codes des Unternehmens	ID-Code des Deri-vats	Art des ID-Codes des Derivats	Portfolio	Fonds-nummer	Derivate in index-und fondsgebun-denen Verträgen	Dem Derivat zugrunde liegendes Instrument	Art des Codes des Vermögenswerts oder der Verbind-lichkeit, der/die dem Derivat zugrunde liegt	Derivat-verwen-dung	Delta	(Forts.)
C0010	C0020	C0030	C0040	C0050	C0060	C0070	C0080	C0090	C0100	C0110	C0120	

Nennwert des Derivats	Käufer/Verkäufer	Bis dato gezahlte Prämie	Bis dato verein-nahmte Prämie	Anzahl der Kontrakte	Kontrakt-größe	Maximalverlust bei Eintritt eines Ereignisses, das zur Auflösung des Kontrakts führt	Abflussbe-trag Swap	Zuflussbe-trag Swap	Vertragsbe-ginn	Laufzeit/Duration	Solvabi-lität-II-Wert	Bewer-tungsme-thode
C0130	C0140	C0150	C0160	C0170	C0180	C0190	C0200	C0210	C0220	C0230	C0240	C0250

Angaben zu Derivaten

ID-Code des Derivats	Art des ID-Codes des Derivats	Name der Gegenpartei	Code der Gegenpartei	Art des Codes der Gegenpartei	Externes Rating	Benannte ECAI	Bonitätsstufe	Internes Rating	Gegenpartei-gruppe	Code der Gegenpartei-gruppe	(Forts.)
C0040	C0050	C0260	C0270	C0280	C0290	C0300	C0310	C0320	C0330	C0340	

Art des Codes der Gegenpartei-gruppe	Bezeichnung des Kontrakts	Währung	CIC	Triggerwert	Auslöser für Kontraktauflösung	Bei einem Swap gezahlte Währung	Bei einem Swap verein-nahmte Währung	Fälligkeits-termin
C0350	C0360	C0370	C0380	C0390	C0400	C0410	C0420	C0430

S.08.02.01

Transaktionen in Derivaten

Angaben zu den gehaltenen Positionen

ID-Code des Derivats	Art des ID-Codes des Derivats	Portfolio	Fonds-nummer	Derivate in index-und fondsgebundenen Verträgen	Dem Derivat zugrunde liegendes Instrument	Art des Codes des Vermögenswerts oder der Verbind-lichkeit, der/die dem Derivat zugrunde liegt	Derivatver-wendung	Nennwert des Derivats	Käufer/Verkäufer	Bis dato gezahlte Prämie	(Forts.)
C0040	C0050	C0060	C0070	C0080	C0090	C0100	C0110	C0120	C0130	C0140	

Bis dato verein-nahmte Prämie	Gewinn und Verlust bis dato	Anzahl der Kontrakte	Kontrakt-größe	Maximalverlust bei Eintritt eines Ereignisses, das zur Auflösung des Kontrakts führt	Abflussbetrag Swap	Zuflussbe-trag Swap	Vertragsbe-ginn	Solvabilität-II-Wert
C0150	C0160	C0170	C0180	C0190	C0200	C0210	C0220	C0230

Angaben zu Derivaten

ID-Code des Derivats	Art des ID-Codes des Derivats	Name der Gegenpartei	Code der Gegenpartei	Art des Codes der Gegenpartei	Gegenpartei-gruppe	Code der Gegenpartei-gruppe	Art des Codes der Gegenpartei-gruppe	Bezeichnung des Kontrakts	Währung	CIC
C0040	C0050	C0240	C0250	C0260	C0270	C0280	C0290	C0300	C0310	C0320

(Forts.)

Triggerwert	Auslöser für Kontraktauflösung	Bei einem Swap gezahlte Währung	Bei einem Swap vereinnahmte Währung	Fälligkeits-termin
C0330	C0340	C0350	C0360	C0370