

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.08.01.04

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 | Gegenpartei-gruppe | Code der Gegenpartei-gruppe | Art des Codes der Gegenpartei-gruppe | Bezeichnung des Kontrakts | Währung | CIC | (Forts.) |
|----------------------|-------------------------------|----------------------|----------------------|-------------------------------|--------------------|-----------------------------|--------------------------------------|---------------------------|---------|-------|----------|
| C0040 | C0050 | C0240 | C0250 | C0260 | C0270 | C0280 | C0290 | C0300 | C0310 | C0320 | |
| | | | | | | | | | | | |

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

S.08.02.04

Transaktionen in Derivaten

Angaben zu den gehaltenen Positionen

| Eingetragener Name des Unternehmens | Identifikationscode des Unternehmens | Art des ID-Codes des Unternehmens | ID-Code des Derivats | Art des ID-Codes des Derivats | Portfolio | Fondsnummer | Derivate in index- und fondsgebundenen Verträgen | Dem Derivat zugrunde liegendes Instrument | Art des Codes des Vermögenswerts oder der Verbindlichkeit, der/die dem Derivat zugrunde liegt | Derivatverwendung | (Forts.) |
|-------------------------------------|--------------------------------------|-----------------------------------|----------------------|-------------------------------|-----------|-------------|--|---|---|-------------------|----------|
| 0010 | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | C0060 | C0070 | C0080 | C0090 | C0100 | C0110 | |
| | | | | | | | | | | | |

| Nennwert des Derivats | Käufer/Verkäufer | Bis dato gezahlte Prämie | Bis dato vereinnahmte Prämie | Gewinn und Verlust bis dato | Anzahl der Kontrakte | Kontraktgröße | Maximalverlust bei Eintritt eines Ereignisses, das zur Auflösung des Kontrakts führt | Abflussbetrag Swap | Zuflussbetrag Swap | Vertragsbeginn | Solvabilität-II-Wert |
|-----------------------|------------------|--------------------------|------------------------------|-----------------------------|----------------------|---------------|--|--------------------|--------------------|----------------|----------------------|
| C0120 | C0130 | C0140 | 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 |
| | | | | |