

S.08.01.01

Offene Derivate

Angaben zu den gehaltenen Positionen

ID-Code des Derivats	Eindeutige Geschäftsabschluss-Kennziffer	Art des ID-Codes des Derivats	Portfolio	Fondsnummer	Derivate in fonds- und indexgebundenen Verträgen	Dem Derivat zugrunde liegendes Instrument	Art des Codes des Vermögenswerts oder der Verbindlichkeit, der/die dem Derivat zugrunde liegt	Derivatverwendung	Nennwert des Derivats	Käufer/Verkäufer	(Forts.)
C0040	C0041	C0050	C0060	C0070	C0080	C0090	C0100	C0110	C0131	C0140	

Bis dato gezahlte Prämie	Bis dato vereinnahmte Prämie	Anzahl der Kontrakte	Kontraktgröße	Maximalverlust bei Eintritt eines Ereignisses, das zur Auflösung des Vertrags führt.	Abflussbetrag Swap	Zuflussbetrag Swap	Vertragsbeginn	Laufzeit/Duration	Solvabilität-II-Wert	Bewertungsmethode
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	Preiswährung	CIC	Triggerwert	Auslöser für Kontraktauflösung	Fälligkeitstermin	Swap – gelieferter Bestandteil	Swap – erhaltener Bestandteil
C0350	C0360	C0370	C0371	C0380	C0390	C0400	C0430	C0440	C0450

S.08.04.01

Offene Derivate

Angaben zu den gehaltenen Positionen

Eingetragener Name des Unternehmens	Identifikationscode des Unternehmens	Art des ID-Codes des Unternehmens	ID-Code des Derivats	Eindeutige Geschäftsabschluss-Kennziffer	Art des ID-Codes des Derivats	Portfolio	Fondsnummer	Derivate in fonds- und indexgebundenen Verträgen	Dem Derivat zugrunde liegendes Instrument	Art des Codes des Vermögenswerts oder der Verbindlichkeit, der/die dem Derivat zugrunde liegt
C0010	C0020	C0030	C0040	C0041	C0050	C0060	C0070	C0080	C0090	C0100

(Forts.)

Derivatverwendung	Nennwert des Derivats	Käufer/Verkäufer	Bis dato gezahlte Prämie	Bis dato vereinnahmte Prämie	Anzahl der Kontrakte	Kontraktgröße	Maximalverlust bei Eintritt eines Ereignisses, das zur Auflösung des Vertrags führt.	Abflussbetrag Swap	Zuflussbetrag Swap	Vertragsbeginn
C0110	C0130	C0140	C0150	C0160	C0170	C0180	C0190	C0200	C0210	C0220

(Forts.)

Laufzeit/Duration	Solvabilität-II-Wert	Bewertungsmethode
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
C0040	C0050	C0260	C0270	C0280	C0290	C0300	C0310	C0320	C0330	C0340

(Forts.)

Art des Codes der Gegenpartei-gruppe	Bezeichnung des Kontrakts	Währung	Preiswährung	CIC	Triggerwert	Auslöser für Kontraktauflösung	Fälligkeitsstermin	Swap – gelieferter Bestandteil	Swap – erhaltener Bestandteil
C0350	C0360	C0370	C0371	C0380	C0390	C0400	C0430	C0440	C0450