

Anlage 6p – Einzelnachweis über Risiken von Finanzinstrumenten  
 Angaben in Fremdwährung bzw. in Euro (Rechnungsabschluss)

| (1)   | (2)                  | (3)  | (4)                            | (5)                                   | (6)   | (7)                                  | (8)                                     | (9)                                      | (10)  | (11)  | (12)  |
|---|----------------------|--|--------------------------------|---------------------------------------|---|--------------------------------------|---|--|---|---|---|
| Wertpapier-<br>bezeichnung  | Währung <sup>1</sup> | Stand<br>in Fremd-<br>währung bzw. EUR<br>31.12.jjjj (t) | Wechselku-<br>rs<br>bei Zugang | Wechsel-<br>kurs<br>31.12.jjjj<br>(t) | Fremdwäh-<br>rungsumrech-<br>nungsrücklage<br>(t) in Euro | Verzins-<br>ung<br>fix/varia-<br>bel | Effektiv-<br>zins<br>31.12.jjj<br>j (t) | Zinsan-<br>-<br>passun-<br>gs-<br>termin | Bonitä-<br>ts-<br>kriteri-<br>en <sup>2</sup><br>31.12.<br>jjjj (t) | Nomin-<br>ale in<br>EUR<br>31.12.j<br>jjj (t) | Ausfallsri-<br>siko über<br>Nominale<br>in EUR<br>31.12.jjjj<br>(t) |
| <b>Bis zur Endfälligkeit gehaltene Finanzinstrumente</b> – Diese werden zu fortgeschriebenen Anschaffungskosten bewertet. |                      |  |                                |                                       |   |                                      |   |  |   |   |   |
| [...]   |                      |  |                                |                                       |   |                                      |   |  |   |   |   |
| [...]   |                      |  |                                |                                       |   |                                      |   |  |   |   |   |
| <b>Zur Veräußerung verfügbare Finanzinstrumente</b> – Diese werden zum beizulegenden Zeitwert bewertet.                   |                      |  |                                |                                       |   |                                      |   |  |   |   |   |
| [...]   |                      |  |                                |                                       |   |                                      |   |  |   |   |   |
| [...]   |                      |  |                                |                                       |   |                                      |   |  |   |   |   |
| <b>Hybrid- und Partizipationskapital</b>  |                      |  |                                |                                       |   |                                      |   |  |   |   |   |
| [...]   |                      |  |                                |                                       |   |                                      |   |  |   |   |   |
| [...]   |                      |  |                                |                                       |   |                                      |   |  |   |   |   |
| <b>Derivative Finanzinstrumente ohne Grundgeschäft</b> – Diese werden zum beizulegenden Zeitwert bewertet.                |                      |  |                                |                                       |   |                                      |   |  |   |   |   |
| [...]   |                      |  |                                |                                       |   |                                      |   |  |   |   |   |
| [...]   |                      |  |                                |                                       |   |                                      |   |  |   |   |   |
| <b>Wirtschaftliche Unternehmungen, Betriebe, betriebsähnliche Einrichtungen nach § 1 Abs. 2<sup>3</sup></b>               |                      |  |                                |                                       |   |                                      |   |  |   |   |   |
| [...]   |                      |  |                                |                                       |   |                                      |   |  |   |   |   |
| [...]   |                      |  |                                |                                       |   |                                      |   |  |   |   |   |
| [...]   |                      |  |                                |                                       |   |                                      |   |  |   |   |   |
| [...]   |                      |  |                                |                                       |   |                                      |   |  |   |   |   |

Fußnoten:

<sup>1</sup> Z. B. CHF, EUR, USD; Währungscode ist immer zu hinterlegen; auch bei EUR.

<sup>2</sup> Bonitätskriterien: 1) Außergewöhnlich gute Kreditqualität, 2) sehr gute Kreditqualität, 3) gute Kreditqualität, 4) zufriedenstellende Kreditqualität, 5) „NON Investment Grade“

<sup>3</sup> Angaben soweit aus dem Rechnungsabschluss der wirtschaftlichen Unternehmungen, Betrieben, betriebsähnlichen Einrichtungen ersichtlich.