

**Anlage 4****zur Verordnung der Finanzmarktaufsichtsbehörde (FMA) über die Gliederung der Pensionskassen-Quartalsausweise (Pensionskassen-Quartalsmeldeverordnung 2025 – PK-QMV 2025)****Auflistung der Derivate**

| Meldeposition     | Bezeichnung der Meldeposition                                                                                            |
|-------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| PK.008.01_C0010PK | ID Code des Derivates;<br>(Derivative ID Code)                                                                           |
| PK.008.01_C0020PK | Art des ID Codes des Derivates;<br>(Type of code)                                                                        |
| PK.008.01_C0090PK | ID Codes des dem Derivates zugrundeliegenden Instruments;<br>(Instrument underlying the derivative ID Code)              |
| PK.008.01_C0100PK | Art des ID Codes des dem Derivates zugrundeliegenden Instruments;<br>(Instrument underlying the derivative Type of code) |
| PK.008.01_C0110   | Verwendung des Derivates;<br>(Use of derivative)                                                                         |
| PK.008.01_C0130   | Nominalbetrag des Derivates;<br>(Notional amount of the derivative)                                                      |
| PK.008.01_C0140   | Käufer / Verkäufer;<br>(Buyer / Seller)                                                                                  |
| PK.008.01_C0150   | Bis dato bezahlte Prämie;<br>(Premium paid to date)                                                                      |
| PK.008.01_C0160   | Bis dato erhaltene Prämie;<br>(Premium received to date)                                                                 |
| PK.008.01_C0170   | Anzahl der Verträge;<br>(Number of contracts)                                                                            |
| PK.008.01_C0180   | Größe des Vertrages;<br>(Contract size)                                                                                  |
| PK.008.01_C0190   | Maximaler Verlust bei Rückabwicklung;<br>(Maximum loss under unwinding event)                                            |
| PK.008.01_C0200   | Betrag des Swap-Abflusses;<br>(Swap outflow amount)                                                                      |
| PK.008.01_C0210   | Betrag des Swap-Zuflusses;<br>(Swap inflow amount)                                                                       |
| PK.008.01_C0220   | Anfangsdatum;<br>(Initial date)                                                                                          |
| PK.008.01_C0230   | Duration;<br>(Duration)                                                                                                  |
| PK.008.01_C0250   | Bewertungsmethode;<br>(Valuation method)                                                                                 |
| PK.008.01_C1100PK | Bilanzwert                                                                                                               |
| PK.008.01_C1110PK | Marktwert                                                                                                                |
| PK.008.01_C0260   | Name des Gegengeschäftspartners;<br>(Counterparty Name)                                                                  |
| PK.008.01_C0270PK | Codes des Gegengeschäftspartners;<br>(Counterparty Code)                                                                 |
| PK.008.01_C0290   | Externes Rating;<br>(External rating)                                                                                    |
| PK.008.01_C0300   | Benannte externe Ratingagentur;<br>(Nominated ECAI)                                                                      |
| PK.008.01_C0330   | Gruppe des Gegengeschäftspartners;<br>(Counterparty Group)                                                               |
| PK.008.01_C0340PK | Code des Gegengeschäftspartners;<br>(Counterparty Code)                                                                  |

|                 |                                                                                                                                               |
|-----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| PK.008.01_C0360 | Name des Vertrages;<br>(Contract name)                                                                                                        |
| PK.008.01_C0370 | Währung;<br>(Currency)                                                                                                                        |
| PK.008.01_C0371 | Währung des Preises;<br>(Currency of price)                                                                                                   |
| PK.008.01_C0380 | Ergänzender Identifikationscode zur Klassifizierung der Vermögenswerte (Vermögenswertkategorie);<br>(CIC – Complementary Identification Code) |
| PK.008.01_C0390 | Auslösender Preis;<br>(Trigger value)                                                                                                         |
| PK.008.01_C0400 | Auslösender Wert für Vertragsrückabwicklung;<br>(Unwind trigger of contract)                                                                  |
| PK.008.01_C0430 | Fälligkeitsdatum;<br>(Maturity date)                                                                                                          |
| PK.008.01_C0440 | Swap geliefert;<br>(Swap delivered)                                                                                                           |
| PK.008.01_C0450 | Swap erhalten;<br>(Swap received)                                                                                                             |

