

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- bezeichnung	Währung ¹	Stand in Fremd- währung bzw. EUR 31.12.jjjj (t)	Wechselku- rs bei Zugang	Wechsel kurs 31.12.jjjj (t)	Fremdwäh- rungsumrech- nungsrücklage (t) in Euro	Verzins- ung fix/varia- bel	Effektiv zins 31.12.jjj j (t)	Zinsan- passun- gs- termin	Bonitä- ts- kriteri- en ² 31.12. jjjj (t)	Nomin- ale in EUR 31.12.j jjj (t)	Ausfallsri- siko über Nominale in EUR 31.12.jjjj (t)
Bis zur Endfälligkeit gehaltene Finanzinstrumente – Diese werden zu fortgeschriebenen Anschaffungskosten bewertet.											
[...]											
[...]											
Zur Veräußerung verfügbare Finanzinstrumente – Diese werden zum beizulegenden Zeitwert bewertet.											
[...]											
[...]											
Hybrid- und Partizipationskapital											
[...]											
[...]											
Derivative Finanzinstrumente ohne Grundgeschäft – Diese werden zum beizulegenden Zeitwert bewertet.											
[...]											
[...]											
Wirtschaftliche Unternehmungen, Betriebe, betriebsähnliche Einrichtungen nach § 1 Abs. 2³											
[...]											
[...]											
[...]											
[...]											

Fußnoten:

¹ Z. B. CHF, EUR, USD; Währungscode ist immer zu hinterlegen; auch bei EUR.² Bonitätskriterien: 1) Außergewöhnlich gute Kreditqualität, 2) sehr gute Kreditqualität, 3) gute Kreditqualität, 4) zufriedenstellende Kreditqualität, 5) „NON Investment Grade“³ Angaben soweit aus dem Rechnungsabschluss der wirtschaftlichen Unternehmungen, Betrieben, betriebsähnlichen Einrichtungen ersichtlich.

