

## L) Tabelle gemäss Art. 25c Abs. 1 Ziff. 4.3 BankV (Einzel- und Konzernabschluss)\*

**OFFENE DERIVATIVE FINANZINSTRUMENTE**

|                                                        |                                                                                                               | HANDELSINSTRUMENTE               |                                  |                 | "HEDGING" INSTRUMENTE            |                                  |                 |
|--------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|-----------------|----------------------------------|----------------------------------|-----------------|
|                                                        |                                                                                                               | Positive Wiederbeschaffungswerte | Negative Wiederbeschaffungswerte | Kontrat-Volumen | Positive Wiederbeschaffungswerte | Negative Wiederbeschaffungswerte | Kontrat-Volumen |
| Zinstrumente                                           | Terminkontrakte inkl. FRAs<br>Swaps<br>Futures<br>Optionen (OTC)<br>Optionen (exchange traded)                |                                  |                                  |                 |                                  |                                  |                 |
| Devisen / Edelmetalle                                  | Terminkontrakte<br>Kombinierte Zins-/Währungsswaps<br>Futures<br>Optionen (OTC)<br>Optionen (exchange traded) |                                  |                                  |                 |                                  |                                  |                 |
| Beteiligungstitel / Indices                            | Terminkontrakte<br>Futures<br>Optionen (OTC)<br>Optionen (exchange traded)                                    |                                  |                                  |                 |                                  |                                  |                 |
| Uebrige **                                             | Terminkontrakte<br>Futures<br>Optionen (OTC)<br>Optionen (exchange traded)                                    |                                  |                                  |                 |                                  |                                  |                 |
| <b>Total vor Berücksichtigung der Nettingverträge:</b> | <b>Berichtsjahr</b>                                                                                           |                                  |                                  |                 |                                  |                                  |                 |
|                                                        | <b>Vorjahr</b>                                                                                                |                                  |                                  |                 |                                  |                                  |                 |

\*\* Z.B. Kreditderivate, Commodities

|                                                         |                                              |                                              |
|---------------------------------------------------------|----------------------------------------------|----------------------------------------------|
| <b>Total nach Berücksichtigung der Nettingverträge:</b> | Positive Wiederbeschaffungswerte (kumuliert) | Negative Wiederbeschaffungswerte (kumuliert) |
| <b>Berichtsjahr</b>                                     |                                              |                                              |
| <b>Vorjahr</b>                                          |                                              |                                              |

\* Fassung vom 18. Dezember 2002