

## L) Tableau synoptique selon l'art. 25c al. 1 ch. 4.3 OB (boucllement individuel et boucllement de groupe)\*

**INSTRUMENTS FINANCIERS DERIVES OUVERTS**

	INSTRUMENTS DE NEGOCE			INSTRUMENTS DE COUVERTURE		
	Valeurs de remplacement positives	Valeurs de remplacement négatives	Montants des sous-jacents	Valeurs de remplacement positives	Valeurs de remplacement négatives	Montants des sous-jacents
Instruments de taux <ul style="list-style-type: none"> <li>▪ contrats à terme, yc FRAs</li> <li>▪ Swaps</li> <li>▪ Futures</li> <li>▪ Options (OTC)</li> <li>▪ Options (exchange traded)</li> </ul>						
Devises / métaux précieux <ul style="list-style-type: none"> <li>▪ contrats à terme</li> <li>▪ swaps combinés d'intérêts et de devises</li> <li>▪ Futures</li> <li>▪ Options (OTC)</li> <li>▪ Options (exchange traded)</li> </ul>						
Titres de participation / indices <ul style="list-style-type: none"> <li>▪ contrats à terme</li> <li>▪ Futures</li> <li>▪ Options (OTC)</li> <li>▪ Options (exchange traded)</li> </ul>						
Autres (par ex. dérivés de crédit, Commodities) <ul style="list-style-type: none"> <li>▪ contrats à terme</li> <li>▪ Futures</li> <li>▪ Options (OTC)</li> <li>▪ Options (exchange traded)</li> </ul>						
<b>Total avant impact des contrats de netting :</b>	<b>Exercice de référence</b>					
	<b>Exercice précédent</b>					
<b>Total après impact des contrats de netting:</b>	Valeurs de remplacement positives (cumulées)			Valeurs de remplacement négatives (cumulées)		
<b>Exercice de référence</b>						
<b>Exercice précédent</b>						