

S.22.01.01

Auswirkung von langfristigen Garantien und Übergangsmaßnahmen

		Auswirkung von langfristigen Garantien und Übergangsmaßnahmen (Schritt-für-Schritt-Ansatz)									
		Betrag mit langfristigen Garantien und Übergangsmaßnahmen	Ohne Übergangsmaßnahme bei versicherungstechnischen Rückstellungen	Auswirkung der Übergangsmaßnahme bei versicherungstechnischen Rückstellungen	Ohne Übergangsmaßnahme beim Zinssatz	Auswirkung der Übergangsmaßnahme beim Zinssatz	Ohne Volatilitätsanpassung und ohne andere Übergangsmaßnahmen	Auswirkung einer Verringerung der Volatilitätsanpassung auf null	Ohne Matching-Anpassung und ohne alle anderen Übergangsmaßnahmen	Auswirkung einer Verringerung der Matching-Anpassung auf null	Auswirkung aller langfristigen Garantien und Übergangsmaßnahmen
		C0010	C0020	C0030	C0040	C0050	C0060	C0070	C0080	C0090	C0100
Versicherungstechnische Rückstellungen	R0010										
Basiseigenmittel	R0020										
Überschuss der Vermögenswerte über die Verbindlichkeiten	R0030										
Gebundene Eigenmittel aufgrund von Sonderverbänden und Matching-Portfolio	R0040										
Für die Erfüllung der Solvenzkapitalanforderung anrechnungsfähige Eigenmittel	R0050										
Tier 1	R0060										
Tier 2	R0070										
Tier 3	R0080										
Solvenzkapitalanforderung	R0090										
Für die Erfüllung der Mindestkapitalanforderung anrechnungsfähige Eigenmittel	R0100										
Mindestkapitalanforderung	R0110										

S.22.01.04

Auswirkung von langfristigen Garantien und Übergangsmaßnahmen

		Auswirkung von langfristigen Garantien und Übergangsmaßnahmen (Schritt-für-Schritt-Ansatz)									
		Betrag mit langfristigen Garantien und Übergangsmaßnahmen	Ohne Übergangsmaßnahme bei versicherungstechnischen Rückstellungen	Auswirkung der Übergangsmaßnahme bei versicherungstechnischen Rückstellungen	Ohne Übergangsmaßnahme beim Zinssatz	Auswirkung der Übergangsmaßnahme beim Zinssatz	Ohne Volatilitätsanpassung und ohne andere Übergangsmaßnahmen	Auswirkung einer Verringerung der Volatilitätsanpassung auf null	Ohne Matching-Anpassung und ohne alle anderen Übergangsmaßnahmen	Auswirkung einer Verringerung der Matching-Anpassung auf null	Auswirkung aller langfristigen Garantien und Übergangsmaßnahmen
		C0010	C0020	C0030	C0040	C0050	C0060	C0070	C0080	C0090	C0100
Versicherungstechnische Rückstellungen	R0010										
Basiseigenmittel	R0020										
Überschuss der Vermögenswerte über die Verbindlichkeiten	R0030										
Gebundene Eigenmittel aufgrund von Sonderverbänden und Matching-Portfolio	R0040										
Für die Erfüllung der SCR anrechnungsfähige Eigenmittel	R0050										
Tier 1	R0060										
Tier 2	R0070										
Tier 3	R0080										
Solvenzkapitalanforderung	R0090										

SR.22.02.01

Projektion der künftigen Zahlungsströme (bester Schätzwert — Matching-Adjustment-Portfolios)

Matching-Portfolio	Z0010	
--------------------	-------	--

		Projektion der künftigen Zahlungsströme am Ende des Berichtszeitraums			Inkongruenz im Berichtszeitraum	
		Zahlungsabflüsse durch Verpflichtungen aufgrund Langlebigkeits-, Sterblichkeits- und Revisionsrisiken	Zahlungsabflüsse durch Aufwendungen	Zahlungsströme der risiko-reduzierten Vermögenswerte	Positive Inkongruenz (nicht abgezinst) (Zuflüsse > Abflüsse)	Negative Inkongruenz (nicht abgezinst) (Zuflüsse < Abflüsse)
		C0020	C0030	C0040	C0050	C0060
Jahr (Projektion der nicht abgezinsten erwarteten Zahlungsströme)						
€ 1	R0010					
€ 2	R0020					
€ 3	R0030					
€ 4	R0040					
€ 5	R0050					
€ 6	R0060					
€ 7	R0070					
€ 8	R0080					
€ 9	R0090					
€ 10	R0100					
€ 11	R0110					
€ 12	R0120					
€ 13	R0130					
€ 14	R0140					
€ 15	R0150					
€ 16	R0160					

		Projektion der künftigen Zahlungsströme am Ende des Berichtszeitraums			Inkongruenz im Berichtszeitraum	
		Zahlungsabflüsse durch Verpflichtungen aufgrund Langlebigkeits-, Sterblichkeits- und Revisionsrisiken	Zahlungsabflüsse durch Aufwendungen	Zahlungsströme der risikoreduzierten Vermögenswerte	Positive Inkongruenz (nicht abgezinst) (Zuflüsse > Abflüsse)	Negative Inkongruenz (nicht abgezinst) (Zuflüsse < Abflüsse)
		C0020	C0030	C0040	C0050	C0060
Jahr (Projektion der nicht abgezinsten erwarteten Zahlungsströme)						
€ 17	R0170					
€ 18	R0180					
€ 19	R0190					
€ 20	R0200					
€ 21	R0210					
€ 22	R0220					
€ 23	R0230					
€ 24	R0240					
€ 25	R0250					
€ 26	R0260					
€ 27	R0270					
€ 28	R0280					
€ 29	R0290					
€ 30	R0300					
€ 31	R0310					
€ 32	R0320					
€ 33	R0330					
€ 34	R0340					
€ 35	R0350					
€ 36	R0360					

		Projektion der künftigen Zahlungsströme am Ende des Berichtszeitraums			Inkongruenz im Berichtszeitraum	
		Zahlungsabflüsse durch Verpflichtungen aufgrund Langlebigkeits-, Sterblichkeits- und Revisionsrisiken	Zahlungsabflüsse durch Aufwendungen	Zahlungsströme der risiko-reduzierten Vermögenswerte	Positive Inkongruenz (nicht abgezinst) (Zuflüsse > Abflüsse)	Negative Inkongruenz (nicht abgezinst) (Zuflüsse < Abflüsse)
		C0020	C0030	C0040	C0050	C0060
Jahr (Projektion der nicht abgezinsten erwarteten Zahlungsströme)						
€ 37	R0370					
€ 38	R0380					
€ 39	R0390					
€ 40	R0400					
41-45	R0410					
46-50	R0420					
51-60	R0430					
61-70	R0440					
71+	R0450					

SR.22.03.01

Angaben zur Berechnung der Matching-Anpassung

Matching-Portfolio	Z0010	
--------------------	-------	--

		C0010
Gesamtberechnung der Matching-Anpassung		X
Auf Zahlungsstrom der Verpflichtungen angewandter effektiver Jahressatz	R0010	
Effektiver Jahressatz des besten Schätzwerts	R0020	
Verwendete Ausfallwahrscheinlichkeit zur Risikoreduzierung der Zahlungsströme der Vermögenswerte	R0030	
Anteil des grundlegenden Spreads, der bei der Risikoreduzierung der Zahlungsströme der Vermögenswerte nicht berücksichtigt wird	R0040	
Erhöhung des grundlegenden Spreads für Vermögenswerte unter dem Investment Grade	R0050	
Matching-Anpassung an den risikofreien Zinssatz	R0060	
Solvenzkapitalanforderung		X
Sterblichkeitsrisikostress zum Zweck der Matching-Anpassung	R0070	
Portfolio		X
Marktwert der Vermögenswerte des Portfolios	R0080	
Marktwert der inflationsabhängigen Vermögenswerte	R0090	
Bester Schätzwert unter Einbeziehung der Inflation	R0100	
Vermögenswerte zum Marktwert, deren Zahlungsströme von Dritten geändert werden können	R0110	
Gesamtkapitalrentabilität — Vermögenswerte des Portfolios	R0120	
Marktwert rückgekaufter Verträge	R0130	
Anzahl der ausgeübten Rückkaufoptionen	R0140	
Marktwert der Vermögenswerte, auf die die Matching-Anpassung angewandt wird	R0150	
Erfüllte Rückkaufsrechte der Versicherungsinhaber	R0160	
Verbindlichkeiten		X
Laufzeit	R0170	

S.22.04.01**Angaben zur Übergangsmaßnahme bei der Berechnung der Zinssätze****Gesamtberechnung der vorübergehenden Anpassung**

Währung	Z0010	
		C0010
Zinssatz nach Solvabilität I	R0010	
Effektiver Jahressatz	R0020	
Anteil der zum Zeitpunkt der Berichterstattung angewandten Differenz	R0030	
Anpassung an den risikofreien Zinssatz	R0040	

Zinssatz nach Solvabilität I

Währung	Z0010
----------------	--------------

		Bester Schätzwert	Durchschnittliche Laufzeit der Versicherungs- und Rückversicherungsverpflichtungen
		C0020	C0030
Bis zu 0,5 Prozent	R0100		
Über 0,5 % bis zu 1,0 %	R0110		
Über 1,0 % bis zu 1,5 %	R0120		
Über 1,5 % bis zu 2,0 %	R0130		
Über 2,0 % bis zu 2,5 %	R0140		
Über 2,5 % bis zu 3,0 %	R0150		
Über 3,0 % bis zu 4,0 %	R0160		
Über 4,0 % bis zu 5,0 %	R0170		
Über 5,0 % bis zu 6,0 %	R0180		
Über 6,0 % bis zu 7,0 %	R0190		
Über 7,0 % bis zu 8,0 %	R0200		
Über 8 %	R0210		

S.22.05.01

Gesamtberechnung bei Anwendung der Übergangsmaßnahme bei versicherungstechnischen Rückstellungen

		C0010
Versicherungstechnische Rückstellungen nach Solvabilität II am ersten Tag	R0010	
Versicherungstechnische Rückstellungen im Falle der Übergangsmaßnahme bei versicherungstechnischen Rückstellungen		X
Versicherungstechnische Rückstellungen als Ganzes berechnet	R0020	
Bester Schätzwert	R0030	
Risikomarge	R0040	
Versicherungstechnische Rückstellungen nach Solvabilität I	R0050	
Anteil der aus der Anpassung resultierenden Differenz	R0060	
Begrenzung nach Artikel 308d Absatz 4	R0070	
Versicherungstechnische Rückstellungen nach Anwendung der Übergangsmaßnahme bei versicherungstechnischen Rückstellungen	R0080	

S.22.06.01

Bester Schätzwert nach Ländern und Währungen im Falle einer Volatilitätsanpassung

Geschäftsbereich	Z0010	
------------------	-------	--

R0010

Nach Währungen	
C0010	...

Bester Schätzwert im Falle einer Volatilitätsanpassung nach Ländern und Währungen — Gesamtwert sowie Herkunftsland nach Währungen

			Gesamtwert des besten Schätzwerts im Falle einer Volatilitätsanpassung (für alle Währungen)	Anteil des besten Schätzwerts im Falle einer Volatilitätsanpassung in der Berichtswährung
			C0030	C0040
Gesamtwert des besten Schätzwerts im Falle einer Volatilitätsanpassung in allen Ländern	R0020	X		
Gesamtwert des besten Schätzwerts im Falle einer Volatilitätsanpassung im Herkunftsland	R0030	X		

Anteil des besten Schätzwerts im Falle einer Volatilitätsanpassung nach Währungen	
C0050	...

Bester Schätzwert im Falle einer Volatilitätsanpassung nach Ländern und Währungen — nach Ländern und Währungen

		Länder	Gesamtwert des besten Schätzwerts im Falle einer Volatilitätsanpassung (für alle Währungen)	Anteil des besten Schätzwerts im Falle einer Volatilitätsanpassung in der Berichtswährung
		C0020	C0030	C0040
Land 1	R0040			
...				

Anteil des besten Schätzwerts im Falle einer Volatilitätsanpassung nach Währungen	
C0050	...