

▼ B**S.06.01 — Zusammenfassung der Vermögenswerte****Allgemeine Bemerkungen:**

Dieser Abschnitt bezieht sich auf die jährliche Übermittlung von Informationen für einzelne Unternehmen. Dieser Meldebogen ist nur von Versicherungs- und Rückversicherungsunternehmen auszufüllen, die nach Artikel 35 Absatz 7 der Richtlinie 2009/138/EG von der jährlichen Übermittlung von Informationen in den Meldebögen S.06.02 oder S.08.01 befreit sind.

Die in diesem Meldebogen aufgeführten Vermögenswertkategorien sind in Anhang IV der vorliegenden Verordnung niedergelegt.

Der Meldebogen enthält eine Zusammenfassung der Informationen über Vermögenswerte und Derivate des Unternehmens als Ganzem, einschließlich der in fonds- und indexgebundenen Verträgen gehaltenen Vermögenswerte und Derivate.

Die Posten sind mit positivem Wert anzugeben, sofern sie keinen negativen Solvabilität-II-Wert aufweisen (z. B. im Falle von Derivaten, die eine Verbindlichkeit des Unternehmens darstellen).

▼ B

| | ELEMENT | HINWEISE |
|--------------------------|--|--|
| C0020 bis C0060/R0010 | Notierte Vermögenswerte | <p>Geben Sie den Wert der notierten Vermögenswerte nach Portfolios an.</p> <p>Für die Zwecke dieses Meldebogens gilt ein Vermögenswert als notiert, wenn er an einem geregelten Markt oder innerhalb eines multilateralen Handelssystems gemäß der Definition in Richtlinie 2004/39/EG gehandelt wird.</p> <p>Bei den Portfolios wird zwischen Leben, Nichtleben, Sonderverbänden, anderen internen Fonds, Eigenmitteln und Allgemein (nicht unterteilt) unterschieden.</p> <p>Die Aufteilung nach Portfolios ist nicht obligatorisch (mit Ausnahme der Angabe von Sonderverbänden), ist aber dennoch bei der Meldung zu verwenden, wenn das Unternehmen sie intern vornimmt. Nimmt ein Unternehmen keine Aufteilung nach Portfolios vor, ist „Allgemein“ anzugeben.</p> |
| C0020 bis C0060/R0020 | Nicht notierte Vermögenswerte | <p>Wert der nicht an einer Börse notierten Vermögenswerte, nach Portfolio.</p> <p>Für die Zwecke dieses Meldebogens gilt ein Vermögenswert als nicht notiert, wenn er nicht an einem geregelten Markt oder innerhalb eines multilateralen Handelssystems gemäß der Definition in Richtlinie 2004/39/EG gehandelt wird.</p> <p>Bei den Portfolios wird zwischen Leben, Nichtleben, Sonderverbänden, anderen internen Fonds, Eigenmitteln und Allgemein (nicht unterteilt) unterschieden.</p> <p>Die Aufteilung nach Portfolios ist nicht obligatorisch (mit Ausnahme der Angabe von Sonderverbänden), ist aber dennoch bei der Meldung zu verwenden, wenn das Unternehmen sie intern vornimmt. Nimmt ein Unternehmen keine Aufteilung nach Portfolios vor, ist „Allgemein“ anzugeben.</p> |
| C0020 bis C0060/R0030 | Nicht an der Börse handelbare Vermögenswerte | <p>Wert der nicht an der Börse handelbaren Vermögenswerte, nach Portfolios.</p> <p>Für die Zwecke dieses Meldebogens gilt ein Vermögenswert als nicht an der Börse handelbar, wenn er aufgrund seiner Beschaffenheit nicht an einem geregelten Markt oder innerhalb eines multilateralen Handelssystems gemäß der Definition in Richtlinie 2004/39/EG gehandelt werden kann.</p> <p>Bei den Portfolios wird zwischen Leben, Nichtleben, Sonderverbänden, anderen internen Fonds, Eigenmitteln und Allgemein (nicht unterteilt) unterschieden.</p> <p>Die Aufteilung nach Portfolios ist nicht obligatorisch (mit Ausnahme der Angabe von Sonderverbänden), ist aber dennoch bei der Meldung zu verwenden, wenn das Unternehmen sie intern vornimmt. Nimmt ein Unternehmen keine Aufteilung nach Portfolios vor, ist „Allgemein“ anzugeben.</p> |
| C0010 bis C0060/R0040 | Staatsanleihen | <p>Wert der Vermögenswerte, die in die Vermögenswertkategorie 1 von Anhang IV — Vermögenswertkategorien einzustufen sind, nach Portfolios.</p> <p>Bei den Portfolios wird zwischen Leben, Nichtleben, Sonderverbänden, anderen internen Fonds, Eigenmitteln und Allgemein (nicht unterteilt) unterschieden.</p> <p>Die Aufteilung nach Portfolios ist nicht obligatorisch (mit Ausnahme der Angabe von Sonderverbänden), ist aber dennoch bei der Meldung zu verwenden, wenn das Unternehmen sie intern vornimmt. Nimmt ein Unternehmen keine Aufteilung nach Portfolios vor, ist „Allgemein“ anzugeben.</p> |
| C0020 bis C0060/R0050 | Unternehmensanleihen | <p>Wert der Vermögenswerte, die in die Vermögenswertkategorie 2 von Anhang IV — Vermögenswertkategorien einzustufen sind, nach Portfolios.</p> <p>Bei den Portfolios wird zwischen Leben, Nichtleben, Sonderverbänden, anderen internen Fonds, Eigenmitteln und Allgemein (nicht unterteilt) unterschieden.</p> <p>Die Aufteilung nach Portfolios ist nicht obligatorisch (mit Ausnahme der Angabe von Sonderverbänden), ist aber dennoch bei der Meldung zu verwenden, wenn das Unternehmen sie intern vornimmt. Nimmt ein Unternehmen keine Aufteilung nach Portfolios vor, ist „Allgemein“ anzugeben.</p> |

▼ B

| | ELEMENT | HINWEISE |
|--------------------------|-----------------------------------|--|
| C0020 bis C0060/R0060 | Eigenkapitalinstrumente | <p>Wert der Vermögenswerte, die in die Vermögenswertkategorie 3 von Anhang IV — Vermögenswertkategorien einzustufen sind, nach Portfolios.</p> <p>Bei den Portfolios wird zwischen Leben, Nichtleben, Sonderverbänden, anderen internen Fonds, Eigenmitteln und Allgemein (nicht unterteilt) unterschieden.</p> <p>Die Aufteilung nach Portfolios ist nicht obligatorisch (mit Ausnahme der Angabe von Sonderverbänden), ist aber dennoch bei der Meldung zu verwenden, wenn das Unternehmen sie intern vornimmt. Nimmt ein Unternehmen keine Aufteilung nach Portfolios vor, ist „Allgemein“ anzugeben.</p> |
| C0020 bis C0060/R0070 | Organismen für gemeinsame Anlagen | <p>Wert der Vermögenswerte, die in die Vermögenswertkategorie 4 von Anhang IV — Vermögenswertkategorien einzustufen sind, nach Portfolios.</p> <p>Bei den Portfolios wird zwischen Leben, Nichtleben, Sonderverbänden, anderen internen Fonds, Eigenmitteln und Allgemein (nicht unterteilt) unterschieden.</p> <p>Die Aufteilung nach Portfolios ist nicht obligatorisch (mit Ausnahme der Angabe von Sonderverbänden), ist aber dennoch bei der Meldung zu verwenden, wenn das Unternehmen sie intern vornimmt. Nimmt ein Unternehmen keine Aufteilung nach Portfolios vor, ist „Allgemein“ anzugeben.</p> |
| C0020 bis C0060/R0080 | Strukturierte Schuldtitel | <p>Wert der Vermögenswerte, die in die Vermögenswertkategorie 5 von Anhang IV — Vermögenswertkategorien einzustufen sind, nach Portfolios.</p> <p>Bei den Portfolios wird zwischen Leben, Nichtleben, Sonderverbänden, anderen internen Fonds, Eigenmitteln und Allgemein (nicht unterteilt) unterschieden.</p> <p>Die Aufteilung nach Portfolios ist nicht obligatorisch (mit Ausnahme der Angabe von Sonderverbänden), ist aber dennoch bei der Meldung zu verwenden, wenn das Unternehmen sie intern vornimmt. Nimmt ein Unternehmen keine Aufteilung nach Portfolios vor, ist „Allgemein“ anzugeben.</p> |
| C0020 bis C0060/R0090 | Besicherte Wertpapiere | <p>Wert der Vermögenswerte, die in die Vermögenswertkategorie 6 von Anhang IV — Vermögenswertkategorien einzustufen sind, nach Portfolios.</p> <p>Bei den Portfolios wird zwischen Leben, Nichtleben, Sonderverbänden, anderen internen Fonds, Eigenmitteln und Allgemein (nicht unterteilt) unterschieden.</p> <p>Die Aufteilung nach Portfolios ist nicht obligatorisch (mit Ausnahme der Angabe von Sonderverbänden), ist aber dennoch bei der Meldung zu verwenden, wenn das Unternehmen sie intern vornimmt. Nimmt ein Unternehmen keine Aufteilung nach Portfolios vor, ist „Allgemein“ anzugeben.</p> |
| C0020 bis C0060/R0100 | Barmittel und Einlagen | <p>Wert der Vermögenswerte, die in die Vermögenswertkategorie 7 von Anhang IV — Vermögenswertkategorien einzustufen sind, nach Portfolios.</p> <p>Bei den Portfolios wird zwischen Leben, Nichtleben, Sonderverbänden, anderen internen Fonds, Eigenmitteln und Allgemein (nicht unterteilt) unterschieden.</p> <p>Die Aufteilung nach Portfolios ist nicht obligatorisch (mit Ausnahme der Angabe von Sonderverbänden), ist aber dennoch bei der Meldung zu verwenden, wenn das Unternehmen sie intern vornimmt. Nimmt ein Unternehmen keine Aufteilung nach Portfolios vor, ist „Allgemein“ anzugeben.</p> |

▼ B

| | ELEMENT | HINWEISE |
|--------------------------|-------------------------|--|
| C0020 bis C0060/R0110 | Hypotheken und Darlehen | <p>Wert der Vermögenswerte, die in die Vermögenswertkategorie 8 von Anhang IV — Vermögenswertkategorien einzustufen sind, nach Portfolios.</p> <p>Bei den Portfolios wird zwischen Leben, Nichtleben, Sonderverbänden, anderen internen Fonds, Eigenmitteln und Allgemein (nicht unterteilt) unterschieden.</p> <p>Die Aufteilung nach Portfolios ist nicht obligatorisch (mit Ausnahme der Angabe von Sonderverbänden), ist aber dennoch bei der Meldung zu verwenden, wenn das Unternehmen sie intern vornimmt. Nimmt ein Unternehmen keine Aufteilung nach Portfolios vor, ist „Allgemein“ anzugeben.</p> |
| C0020 bis C0060/R0120 | Immobilien | <p>Wert der Vermögenswerte, die in die Vermögenswertkategorie 9 von Anhang IV — Vermögenswertkategorien einzustufen sind, nach Portfolios.</p> <p>Bei den Portfolios wird zwischen Leben, Nichtleben, Sonderverbänden, anderen internen Fonds, Eigenmitteln und Allgemein (nicht unterteilt) unterschieden.</p> <p>Die Aufteilung nach Portfolios ist nicht obligatorisch (mit Ausnahme der Angabe von Sonderverbänden), ist aber dennoch bei der Meldung zu verwenden, wenn das Unternehmen sie intern vornimmt. Nimmt ein Unternehmen keine Aufteilung nach Portfolios vor, ist „Allgemein“ anzugeben.</p> |
| C0020 bis C0060/R0130 | Sonstige Anlagen | <p>Wert der Vermögenswerte, die in die Vermögenswertkategorie 0 von Anhang IV — Vermögenswertkategorien einzustufen sind, nach Portfolios.</p> <p>Bei den Portfolios wird zwischen Leben, Nichtleben, Sonderverbänden, anderen internen Fonds, Eigenmitteln und Allgemein (nicht unterteilt) unterschieden.</p> <p>Die Aufteilung nach Portfolios ist nicht obligatorisch (mit Ausnahme der Angabe von Sonderverbänden), ist aber dennoch bei der Meldung zu verwenden, wenn das Unternehmen sie intern vornimmt. Nimmt ein Unternehmen keine Aufteilung nach Portfolios vor, ist „Allgemein“ anzugeben.</p> |
| C0020 bis C0060/R0140 | Futures | <p>Wert der Vermögenswerte, die in die Vermögenswertkategorie A von Anhang IV — Vermögenswertkategorien einzustufen sind, nach Portfolios.</p> <p>Bei den Portfolios wird zwischen Leben, Nichtleben, Sonderverbänden, anderen internen Fonds, Eigenmitteln und Allgemein (nicht unterteilt) unterschieden.</p> <p>Die Aufteilung nach Portfolios ist nicht obligatorisch (mit Ausnahme der Angabe von Sonderverbänden), ist aber dennoch bei der Meldung zu verwenden, wenn das Unternehmen sie intern vornimmt. Nimmt ein Unternehmen keine Aufteilung nach Portfolios vor, ist „Allgemein“ anzugeben.</p> |
| C0020 bis C0060/R0150 | Kaufoptionen | <p>Wert der Vermögenswerte, die in die Vermögenswertkategorie B von Anhang IV — Vermögenswertkategorien einzustufen sind, nach Portfolios.</p> <p>Bei den Portfolios wird zwischen Leben, Nichtleben, Sonderverbänden, anderen internen Fonds, Eigenmitteln und Allgemein (nicht unterteilt) unterschieden.</p> <p>Die Aufteilung nach Portfolios ist nicht obligatorisch (mit Ausnahme der Angabe von Sonderverbänden), ist aber dennoch bei der Meldung zu verwenden, wenn das Unternehmen sie intern vornimmt. Nimmt ein Unternehmen keine Aufteilung nach Portfolios vor, ist „Allgemein“ anzugeben.</p> |

▼ **B**

| | ELEMENT | HINWEISE |
|--------------------------|------------------|--|
| C0020 bis C0060/R0160 | Verkaufsoptionen | <p>Wert der Vermögenswerte, die in die Vermögenswertkategorie C von Anhang IV — Vermögenswertkategorien einzustufen sind, nach Portfolios.</p> <p>Bei den Portfolios wird zwischen Leben, Nichtleben, Sonderverbänden, anderen internen Fonds, Eigenmitteln und Allgemein (nicht unterteilt) unterschieden.</p> <p>Die Aufteilung nach Portfolios ist nicht obligatorisch (mit Ausnahme der Angabe von Sonderverbänden), ist aber dennoch bei der Meldung zu verwenden, wenn das Unternehmen sie intern vornimmt. Nimmt ein Unternehmen keine Aufteilung nach Portfolios vor, ist „Allgemein“ anzugeben.</p> |
| C0020 bis C0060/R0170 | Swaps | <p>Wert der Vermögenswerte, die in die Vermögenswertkategorie D von Anhang IV — Vermögenswertkategorien einzustufen sind, nach Portfolios.</p> <p>Bei den Portfolios wird zwischen Leben, Nichtleben, Sonderverbänden, anderen internen Fonds, Eigenmitteln und Allgemein (nicht unterteilt) unterschieden.</p> <p>Die Aufteilung nach Portfolios ist nicht obligatorisch (mit Ausnahme der Angabe von Sonderverbänden), ist aber dennoch bei der Meldung zu verwenden, wenn das Unternehmen sie intern vornimmt. Nimmt ein Unternehmen keine Aufteilung nach Portfolios vor, ist „Allgemein“ anzugeben.</p> |
| C0020 bis C0060/R0180 | Forwards | <p>Wert der Vermögenswerte, die in die Vermögenswertkategorie E von Anhang IV — Vermögenswertkategorien einzustufen sind, nach Portfolios.</p> <p>Bei den Portfolios wird zwischen Leben, Nichtleben, Sonderverbänden, anderen internen Fonds, Eigenmitteln und Allgemein (nicht unterteilt) unterschieden.</p> <p>Die Aufteilung nach Portfolios ist nicht obligatorisch (mit Ausnahme der Angabe von Sonderverbänden), ist aber dennoch bei der Meldung zu verwenden, wenn das Unternehmen sie intern vornimmt. Nimmt ein Unternehmen keine Aufteilung nach Portfolios vor, ist „Allgemein“ anzugeben.</p> |
| C0020 bis C0060/R0190 | Kreditderivate | <p>Wert der Vermögenswerte, die in die Vermögenswertkategorie F von Anhang IV — Vermögenswertkategorien einzustufen sind, nach Portfolios.</p> <p>Bei den Portfolios wird zwischen Leben, Nichtleben, Sonderverbänden, anderen internen Fonds, Eigenmitteln und Allgemein (nicht unterteilt) unterschieden.</p> <p>Die Aufteilung nach Portfolios ist nicht obligatorisch (mit Ausnahme der Angabe von Sonderverbänden), ist aber dennoch bei der Meldung zu verwenden, wenn das Unternehmen sie intern vornimmt. Nimmt ein Unternehmen keine Aufteilung nach Portfolios vor, ist „Allgemein“ anzugeben.</p> |

S.06.02 — Liste der Vermögenswerte**Allgemeine Bemerkungen:**

Dieser Abschnitt bezieht sich auf die vierteljährliche und die jährliche Übermittlung von Informationen für einzelne Unternehmen.

Die in diesem Meldebogen aufgeführten Vermögenswertkategorien sind in Anhang IV der vorliegenden Verordnung niedergelegt; die hier aufgeführten CIC-Codes beziehen sich auf Anhang VI, der die Tabelle des Complementary Identification Code („CIC“) enthält.

▼ B

Auf diesem Meldebogen sind alle in der Bilanz ausgewiesenen Vermögenswerte aufzuführen, die in die Vermögenswertkategorien 0 bis 9 von Anhang IV — Vermögenswertkategorien der vorliegenden Verordnung einzustufen sind. Insbesondere sind auf diesem Meldebogen die Sicherheiten anzugeben, die in der Bilanz für Wertpapierleihgeschäfte und Repogeschäfte eingesetzt sind.

Dieser Meldebogen enthält eine nach Einzelposten (d. h. nicht nach dem Look-Through-Ansatz) erstellte Liste der vom Unternehmen direkt gehaltenen Vermögenswerte, die in die Vermögenswertkategorien 0 bis 9 einzustufen sind (auch für die vom (Rück-)Versicherungsunternehmen verwalteten fonds- und indexgebundenen Produkte werden nur diejenigen Vermögenswerte übermittelt, die unter die Vermögenswertkategorien 0 bis 9 fallen, so dass z. B. mit diesen Produkten verbundene einforderbare Beträge oder Verbindlichkeiten nicht zu übermitteln sind), mit folgenden Ausnahmen:

- a) Barmittel sind für jede Kombination der Elemente C0060, C0070, C0080 und C0090 in einer Zeile pro Währung anzugeben.
- b) Jederzeit verfügbare Einlagen (Zahlungsmitteläquivalente) und andere Einlagen mit Laufzeiten von weniger als einem Jahr sind für jede Kombination der Elemente C0060, C0070, C0080, C0090 und C0290 in einer Zeile pro Paar (Bank, Währung) anzugeben.
- c) Hypotheken und Darlehen an Privatpersonen, einschließlich Policendarlehen, sind in zwei Zeilen anzugeben, wobei eine Zeile für Darlehen an Mitglieder von Verwaltungs-, Management- oder Aufsichtsorganen und eine Zeile für Darlehen an andere Personen vorgesehen ist, und dies in beiden Fällen für jede Kombination der Elemente C0060, C0070, C0080, C0090 und C0290.
- d) Depotforderungen sind für jede Kombination der Elemente C0060, C0070, C0080 und C0090 in nur einer Zeile anzugeben.
- e) Anlagen zur Eigennutzung durch das Unternehmen sind für jede Kombination der Elemente C0060, C0070, C0080 und C0090 in nur einer Zeile anzugeben.

Der vorliegende Meldebogen besteht aus zwei Tabellen: Angaben zu den gehaltenen Positionen und Angaben zu Vermögenswerten.

▼ M1

In der Tabelle „Angaben zu den gehaltenen Positionen“ ist jeder Vermögenswert einzeln aufzuführen, und zwar in so vielen Zeilen, wie zur ordnungsgemäßen Angabe aller in dieser Tabelle erfragten nicht monetären Variablen mit Ausnahme des Elements „Menge“ erforderlich sind. Wenn für denselben Vermögenswert einer Variable zwei Werte zugewiesen werden können, dann ist dieser Vermögenswert in mehr als einer Zeile zu übermitteln.

▼ B

In der Tabelle „Angaben zu Vermögenswerten“ ist jeder Vermögenswert einzeln aufzuführen, und zwar in einer Zeile pro Vermögenswert, wobei alle in dieser Tabelle erfragten Variablen einzutragen sind.

Die Angaben zum externen Rating (C0320) und zur benannten ECAI (External Credit Assessment Institution) (C0330) dürfen unter folgenden Voraussetzungen beschränkt werden (entfallen):

- a) per Befreiungsbeschluss der nationalen Aufsichtsbehörde gemäß Artikel 35 Absätze 6 und 7 der Richtlinie 2009/138/EG oder
- b) per Beschluss der nationalen Aufsichtsbehörde, falls den Versicherungs- und Rückversicherungsunternehmen diese spezifischen Informationen infolge von Outsourcing-Regelungen im Anlagebereich nicht unmittelbar zugänglich sind.

▼ **B**

| | ELEMENT | HINWEISE |
|---|-------------------------------------|---|
| Angaben zu den gehaltenen Positionen | | |
| C0040 | ID-Code des Vermögenswerts | <p>ID-Code des Vermögenswerts nach absteigender Priorität:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISO 6166 ISIN, wenn verfügbar — Andere anerkannte Codes (z. B.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Vom Unternehmen vergebener Code, wenn die vorstehenden Optionen nicht verfügbar sind. Dieser Code muss einmalig sein und im Zeitverlauf unverändert beibehalten werden. <p>Wenn für ein und denselben Vermögenswert, der in zwei oder mehr verschiedenen Währungen begeben wird, derselbe ID-Code verwendet wird, ist sowohl der ID-Code des Vermögenswerts als auch der alphabetische Code der Währung nach ISO 4217 anzugeben, und zwar nach folgendem Muster: „Code+EUR“.</p> |
| C0050 | Art des ID-Codes des Vermögenswerts | <p>Art des ID-Codes, der für das Element „ID-Code des Vermögenswerts“ verwendet wird. Aus der folgenden erschöpfenden Liste ist eine Option auszuwählen:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — ISO 6166 ISIN 2 — CUSIP (die vom Service Bureau des Committee on Uniform Securities Identification Procedures, CUSIP, für US-amerikanische und kanadische Unternehmen vergebene Nummer) 3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List für die London Stock Exchange) 4 — WKN (Wertpapierkennnummer, die alphanumerische ID in Deutschland) 5 — Bloomberg Ticker (die von Bloomberg vergebene Buchstabenkennung für Finanztitel) 6 — BBGID (Bloomberg Global ID) 7 — Reuters RIC (Reuters Instrument Code) 8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier) 9 — Andere von Mitgliedern der Association of National Numbering Agencies vergebene Kennung 99 — Vom Unternehmen vergebener Code <p>► M1 Wenn für ein und denselben Vermögenswert, der in zwei oder mehr verschiedenen Währungen begeben wird, derselbe ID-Code angegeben werden muss und der in Element C0040 angegebene Code aus dem ID-Code des Vermögenswerts und dem alphabetischen Währungscode nach ISO 4217 zusammengesetzt ist, dann ist als „Art des ID-Codes des Vermögenswerts“ die Option 99 und die Option für den ursprünglichen ID-Code des Vermögenswerts anzugeben, und zwar nach dem Muster des folgenden Beispiels, in dem sich der gemeldete Code aus ISIN-Code + Währungscode zusammensetzt: „99/1“. ◀</p> |
| C0060 | Portfolio | <p>Unterscheidung zwischen Leben, Nichtleben, Eigenmitteln, anderen internen Fonds, Allgemein (nicht unterteilt) und Sonderverbänden. Aus der folgenden erschöpfenden Liste ist eine Option auszuwählen:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — Leben 2 — Nichtleben 3 — Sonderverbände 4 — Andere interne Fonds 5 — Eigenmittel 6 — Allgemein |

▼ **B**

| | ELEMENT | HINWEISE |
|-------|--|---|
| | | Die Untergliederung ist nicht obligatorisch (mit Ausnahme der Angabe von Sonderverbänden), ist aber dennoch bei der Meldung zu verwenden, wenn das Unternehmen sie intern verwendet. Nimmt ein Unternehmen keine Untergliederung vor, ist „Allgemein“ anzugeben. |
| C0070 | Fondsnummer | Gilt für Vermögenswerte, die in Sonderverbänden oder anderen internen Fonds gehalten werden (Definition entsprechend den nationalen Märkten). Die vom Unternehmen vergebene Nummer, die der einmaligen Nummer entspricht, mit der jeder einzelne Fonds bezeichnet wird. Diese Nummer ist im Zeitverlauf unverändert beizubehalten und auch in anderen Meldebögen zur Kennzeichnung der Fonds zu verwenden. Sie darf für keinen anderen Fonds wiederverwendet werden. |
| C0080 | Matching-Portfolio-Nummer | Diese vom Unternehmen vergebene Nummer entspricht der einmaligen Nummer, die dem gemäß den Bestimmungen von Artikel 77b Absatz 1 Buchstabe a der Richtlinie 2009/138/EG festgelegten Matching-Adjustment-Portfolio zugewiesen wird. Diese Nummer ist im Zeitverlauf unverändert beizubehalten und auch in anderen Meldebögen zur Kennzeichnung des Matching-Adjustment-Portfolios zu verwenden. Sie darf für kein anderes Matching-Adjustment-Portfolio wiederverwendet werden. |
| C0090 | Vermögenswerte in fonds- und indexgebundenen Verträgen | Geben Sie die in fonds- und indexgebundenen Verträgen gehaltenen Vermögenswerte an. Aus der folgenden erschöpfenden Liste ist eine Option auszuwählen: 1 — Fonds- oder indexgebunden 2 — Weder fonds- noch indexgebunden |
| C0100 | Als Sicherheit gestellte Vermögenswerte | Geben Sie die in der Bilanz des Unternehmens als gestellte Sicherheit ausgewiesenen Vermögenswerte an. Für teilweise als Sicherheit gestellte Vermögenswerte sind jeweils zwei Zeilen auszufüllen, eine für den als Sicherheit gestellten Betrag und eine für den Restbetrag. Aus der folgenden erschöpfenden Liste ist eine Option für den als Sicherheit gestellten Teil des Vermögenswerts auszuwählen: 1 — Vermögenswerte in der Bilanz, die als Sicherheit gestellt wurden 2 — Sicherheit für in Rückdeckung übernommenes Geschäft 3 — Sicherheit für geliehene Wertpapiere 4 — Repos 9 — Keine Sicherheit |
| C0110 | Verwahrungsland | ► M1 ISO 3166-1 Alpha-2-Code des Landes, in dem Vermögenswerte des Unternehmens verwahrt werden. Bei der Ausweisung internationaler Verwahrstellen wie Euroclear ist das Verwahrungsland das Land, in dem die Verwahrungsdienstleistung vertraglich festgelegt wurde. ◀ Falls derselbe Vermögenswert in mehr als einem Land verwahrt wird, ist er jeweils einzeln in so vielen Zeilen aufzuführen, wie es zur ordnungsgemäßen Angabe sämtlicher Verwahrungsländer erforderlich ist. ► M3 Dieses Element gilt nicht für CIC-Kategorie 8 Hypotheken und Darlehen,, CIC 71, CIC 75 und CIC 95“ Anlagen,,“; ◀ Im Hinblick auf CIC-Kategorie 9, ausgenommen CIC 95 — Anlagen (zur Eigennutzung), richtet sich das Land des Emittenten nach der Immobilienadresse. |

▼ **B**

| | ELEMENT | HINWEISE |
|-------|-------------------------------|--|
| C0120 | Verwahrer | <p>Name des verwahrenden Finanzinstituts.</p> <p>Falls derselbe Vermögenswert von mehr als einem Verwahrer verwahrt wird, ist er jeweils einzeln in so vielen Zeilen aufzuführen, wie es zur ordnungsgemäßen Angabe sämtlicher Verwahrer erforderlich ist.</p> <p>Sofern verfügbar, ist in diesem Element der in der LEI-Datenbank hinterlegte Name des Rechtsträgers anzugeben. Andernfalls ist der eingetragene Name anzugeben.</p> <p>► M3 Dieses Element gilt nicht für CIC-Kategorie 8 Hypotheken und Darlehen,, CIC 71, CIC 75 und CIC-Kategorie 9“ Immobilien,,“; ◀</p> |
| C0130 | Menge | <p>Anzahl der Vermögenswerte, für wesentliche Vermögenswerte</p> <p>Dieses Element ist nicht zu übermitteln, wenn das Element C0140 (Nennwert) gemeldet wird.</p> <p>► M3 Dieses Element gilt nicht für die CIC-Kategorien 71 und 9. ◀</p> |
| C0140 | Nennwert | <p>► M1 Ausstehender Betrag, zum Nennwert, für alle Vermögenswerte, bei denen dieses Element relevant ist, und zum Nominalwert für CIC = 72, 73, 74, 75, 79 und 8. Dieses Element gilt nicht für die CIC-Kategorien 71 und 9. Dieses Element ist nicht zu übermitteln, wenn das Element „Menge“ (C0130) übermittelt wird. ◀</p> |
| C0150 | Bewertungsmethode | <p>Geben Sie an, nach welcher Methode die Vermögenswerte bewertet werden. Aus der folgenden erschöpfenden Liste ist eine Option auszuwählen:</p> <p>1 — Marktpreisnotierung auf aktiven Märkten für gleiche Vermögenswerte</p> <p>2 — Marktpreisnotierung auf aktiven Märkten für ähnliche Vermögenswerte</p> <p>3 — Alternative Bewertungsmethoden</p> <p>4 — Angepasste Equity-Methoden (bei der Bewertung von Beteiligungen anwendbar):</p> <p>5 — IFRS-Equity-Methoden (bei der Bewertung von Beteiligungen anwendbar)</p> <p>6 — Marktbewertung nach Artikel 9 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/35.</p> |
| C0160 | Anschaffungswert | <p>Anschaffungswert der gehaltenen Vermögenswerte insgesamt, Wert ohne aufgelaufene Zinsen. Gilt nicht für die CIC-Kategorien 7 und 8.</p> |
| C0170 | Solvabilität-II-Gesamt-betrag | <p>► M1 Der gemäß Artikel 75 der Richtlinie 2009/138/EG berechnete Wert. Dabei ist Folgendes zu beachten:</p> <ul style="list-style-type: none"> — entspricht bei Vermögenswerten, für die die ersten beiden Elemente relevant sind, dem Produkt aus den Elementen „Nennwert“ (ausstehender Kapitalbetrag, zum Nennwert oder Nominalwert) und „Prozentualer Anteil des Nennwerts des Solvabilität-II-Preises je Einheit“ zuzüglich „Aufgelaufene Zinsen“; — ► M2 entspricht bei Vermögenswerten, für die diese beiden Elemente relevant sind, dem Produkt aus „Menge“ und „Solvabilität-II-Preis je Einheit“ (zuzüglich „Aufgelaufener Zinsen“, falls relevant); ◀ — bei Vermögenswerten, die in die Vermögenswertkategorien 71 und 9 einzustufen sind, ist der Solvabilität-II-Wert anzugeben. ◀ |

▼ **B**

| | ELEMENT | HINWEISE |
|-------|---------------------|---|
| C0180 | Aufgelaufene Zinsen | Geben Sie für verzinsliche ► M2 Vermögenswerte ◀ den seit dem letzten Kupontermi n aufgelaufenen Zinsbetrag an. Beachten Sie, dass dieser Wert auch im Element „Solvabilität-II-Gesamtbetrag“ enthalten ist. |

| | ELEMENT | HINWEISE |
|--|---------|----------|
|--|---------|----------|

Angaben zu Vermögenswerten

| | | |
|-------|-------------------------------------|--|
| C0040 | ID-Code des Vermögenswerts | <p>ID-Code des Vermögenswerts nach absteigender Priorität:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISO 6166 ISIN, wenn verfügbar — Andere anerkannte Codes (z. B.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Vom Unternehmen vergebener Code, wenn die vorstehenden Optionen nicht verfügbar sind. Dieser Code muss einmalig sein und im Zeitverlauf unverändert beibehalten werden. <p>Wenn für ein und denselben Vermögenswert, der in zwei oder mehr verschiedenen Währungen begeben wird, derselbe ID-Code verwendet wird, ist sowohl der ID-Code des Vermögenswerts als auch der alphabetische Code der Währung nach ISO 4217 anzugeben, und zwar nach folgendem Muster: „Code+EUR“.</p> |
| C0050 | Art des ID-Codes des Vermögenswerts | <p>Art des ID-Codes, der für das Element „ID-Code des Vermögenswerts“ verwendet wird. Aus der folgenden erschöpfenden Liste ist eine Option auszuwählen:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — ISO 6166 ISIN 2 — CUSIP (die vom Service Bureau des Committee on Uniform Securities Identification Procedures, CUSIP, für US-amerikanische und kanadische Unternehmen vergebene Nummer) 3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List für die London Stock Exchange) 4 — WKN (Wertpapierkennnummer, die alphanumerische ID in Deutschland) 5 — Bloomberg Ticker (die von Bloomberg vergebene Buchstabenkennung für Finanztitel) 6 — BBGID (Bloomberg Global ID) ► M2 7 — Reuters RIC (Reuters Instrument Code) ◀ 8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier) 9 — Andere von Mitgliedern der Association of National Numbering Agencies vergebene Kennung 99 — Vom Unternehmen vergebener Code <p>Wenn für ein und denselben Vermögenswert, der in zwei oder mehr verschiedenen Währungen begeben wird, derselbe ID-Code angegeben werden muss und der in Element C0040 angegebene Code aus dem ID-Code des Vermögenswerts und dem alphabetischen Währungscode nach ISO 4217 zusammengesetzt ist, dann ist als „Art des ID-Codes des Vermögenswerts“ die Option 9 und die Option für den ursprünglichen ID-Code des Vermögenswerts anzugeben, und zwar nach dem Muster des folgenden Beispiels, in dem sich der gemeldete Code aus ISIN-Code+Währungscode zusammensetzt: ► M2 „99/1“ ◀.</p> |
| C0190 | Bezeichnung der Position | Angabe der Berichtsposition durch Eintragung der Vermögenswertbezeichnung oder der Anschrift von Immobilien; die Genauigkeit der Angaben liegt im Ermessen des Unternehmens. |

▼ **B**

| | ELEMENT | HINWEISE |
|-------|---------------------|--|
| | | <p>Dabei ist Folgendes zu beachten:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Im Hinblick auf CIC-Kategorie 8 — Hypotheken und Darlehen ist in diesem Element, wenn es sich um natürlichen Personen gewährte Hypotheken und Darlehen handelt, „Darlehen an Mitglieder des Verwaltungs-, Management- oder Aufsichtsorgans“ oder „Darlehen an andere natürliche Personen“ anzugeben, da für diese Vermögenswerte kein Individualisierungsgebot besteht. Nicht an natürliche Personen vergebene Darlehen sind in einzelnen Zeilen anzugeben. — Dieses Element gilt nicht für CIC 95 — Anlagen (zur Eigennutzung), da für diese Vermögenswerte kein Individualisierungsgebot besteht, und nicht für CIC 71 und CIC 75. |
| C0200 | Name des Emittenten | <p>Der Emittent ist das Wertpapiere an Anleger ausgebende Unternehmen. Sofern verfügbar, ist in diesem Element der in der LEI-Datenbank hinterlegte Name des Rechtsträgers anzugeben. Andernfalls ist der eingetragene Name des Unternehmens anzugeben.</p> <p>Dabei ist Folgendes zu beachten:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Im Hinblick auf die CIC-Kategorie 4 — Organismen für gemeinsame Anlagen ist der Name des Emittenten der Name des Fondsmanagers. — Im Hinblick auf CIC-Kategorie 7 — Barmittel und Einlagen (ausgenommen CIC 71 und CIC 75) ist der Name des Emittenten der Name der Depotstelle. — Im Hinblick auf CIC-Kategorie 8 — Hypotheken und Darlehen ist in diesem Element, wenn es sich um natürlichen Personen gewährte Hypotheken und Darlehen handelt, „Darlehen an Mitglieder des Verwaltungs-, Management- oder Aufsichtsorgans“ oder „Darlehen an andere natürliche Personen“ anzugeben, da für diese Vermögenswerte kein Individualisierungsgebot besteht. — Im Hinblick auf CIC 8 — Hypotheken und Darlehen, andere als Hypotheken und Darlehen an natürliche Personen, beziehen sich die Angaben auf den Darlehensnehmer. — Dieses Element gilt nicht für CIC 71, CIC 75 und CIC-Kategorie 9 — Immobilien. |
| C0210 | Emittentencode | <p>Angabe des Emittentencodes in Form der Rechtsträgerkennung (LEI), sofern verfügbar.</p> <p>Liegt kein solcher Code vor, ist dieses Element nicht zu berichten.</p> <p>Dabei ist Folgendes zu beachten:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Im Hinblick auf die CIC-Kategorie 4 — Organismen für gemeinsame Anlagen ist der Emittentencode der Code des Fondsmanagers; — Im Hinblick auf CIC-Kategorie 7 — Barmittel und Einlagen (ausgenommen CIC 71 und CIC 75) ist der Emittentencode der Code der Depotstelle. — Im Hinblick auf CIC 8 — Hypotheken und Darlehen, andere als Hypotheken und Darlehen an natürliche Personen, beziehen sich die Angaben auf den Darlehensnehmer. — Dieses Element gilt nicht für CIC 71, CIC 75 und CIC-Kategorie 9 — Immobilien. — Dieses Element gilt nicht für Kategorie 8 — Hypotheken und Darlehen, wenn es sich um natürlichen Personen gewährte Hypotheken und Darlehen handelt. |

▼ **B**

| | ELEMENT | HINWEISE |
|-------|---------------------------------|---|
| C0220 | Art des Emittentencodes | <p>Angabe der Art des Codes, der im Element „Emittentencode“ eingetragen wurde. Aus der folgenden erschöpfenden Liste ist eine Option auszuwählen:</p> <p>1 — Rechtsträgerkennung (LEI) 9 — Keine Angabe</p> <p>Dieses Element gilt nicht für Kategorie 8 — Hypotheken und Darlehen, wenn es sich um natürlichen Personen gewährte Hypotheken und Darlehen handelt.</p> <p>Dieses Element gilt nicht für CIC 71, CIC 75 und CIC-Kategorie 9 — Immobilien.</p> |
| C0230 | Wirtschaftszweig des Emittenten | <p>Geben Sie den Wirtschaftszweig des Emittenten anhand der aktuell gültigen Codes der Statistischen Systematik der Wirtschaftszweige in der Europäischen Gemeinschaft („NACE“) (laut EG-Verordnung) an. Die Buchstabenkennung, die für den NACE-Abschnitt steht, ist als Mindestangabe für den Wirtschaftszweig zu verwenden (so wäre z. B. „A“ oder „A11“ angemessen); wenn sich der NACE-Code allerdings auf die Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen bezieht, ist dem Buchstaben für den Abschnitt noch der vierstellige numerische Code der NACE-Klasse (z. B. „K6411“) beizufügen.</p> <p>Dabei ist Folgendes zu beachten:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Im Hinblick auf die CIC-Kategorie 4 — Organismen für gemeinsame Anlagen ist der Wirtschaftszweig des Emittenten der Wirtschaftszweig des Fondsmanagers. — Im Hinblick auf CIC-Kategorie 7 — Barmittel und Einlagen (ausgenommen CIC 71 und CIC 75) ist der Wirtschaftszweig des Emittenten der Wirtschaftszweig der Depotstelle. — Im Hinblick auf CIC 8 — Hypotheken und Darlehen, andere als Hypotheken und Darlehen an natürliche Personen, beziehen sich die Angaben auf den Darlehensnehmer. — Dieses Element gilt nicht für CIC 71, CIC 75 und CIC-Kategorie 9 — Immobilien. — Dieses Element gilt nicht für Kategorie 8 — Hypotheken und Darlehen, wenn es sich um natürlichen Personen gewährte Hypotheken und Darlehen handelt. |
| C0240 | Emittentengruppe | <p>Name der gemeinsamen Muttergesellschaft des Emittenten. Bei Organismen für gemeinsame Anlagen bezieht sich die Gruppenbeziehung auf den Fondsmanager.</p> <p>Sofern verfügbar, ist in diesem Element der in der LEI-Datenbank hinterlegte Name des Rechtsträgers anzugeben. Andernfalls ist der eingetragene Name des Unternehmens anzugeben.</p> <p>Dabei ist Folgendes zu beachten:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Im Hinblick auf die CIC-Kategorie 4 — Organismen für gemeinsame Anlagen bezieht sich die Gruppenbeziehung auf den Fondsmanager; — Im Hinblick auf CIC-Kategorie 7 — Barmittel und Einlagen (ausgenommen CIC 71 und CIC 75) bezieht sich die Gruppenbeziehung auf die Depotstelle. — Im Hinblick auf CIC 8 — Hypotheken und Darlehen, andere als Hypotheken und Darlehen an natürliche Personen, bezieht sich die Gruppenbeziehung auf den Darlehensnehmer. — Dieses Element gilt nicht für Kategorie 8 — Hypotheken und Darlehen, wenn es sich um natürlichen Personen gewährte Hypotheken und Darlehen handelt. — Dieses Element gilt nicht für CIC 71, CIC 75 und CIC-Kategorie 9 — Immobilien. |

▼ B

| | ELEMENT | HINWEISE |
|-------|------------------------------------|--|
| C0250 | Code der Emittentengruppe | <p>Identifikationscode der Emittentengruppe in Form der Rechtsträgerkennung (LEI), sofern verfügbar.</p> <p>Liegt kein solcher Code vor, ist dieses Element nicht zu berichten.</p> <p>Dabei ist Folgendes zu beachten:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Im Hinblick auf die CIC-Kategorie 4 — Organismen für gemeinsame Anlagen bezieht sich die Gruppenbeziehung auf den Fondsmanager. — Im Hinblick auf CIC-Kategorie 7 — Barmittel und Einlagen (ausgenommen CIC 71 und CIC 75) bezieht sich die Gruppenbeziehung auf die Depotstelle. — Im Hinblick auf CIC 8 — Hypotheken und Darlehen, andere als Hypotheken und Darlehen an natürliche Personen, bezieht sich die Gruppenbeziehung auf den Darlehensnehmer. — Dieses Element gilt nicht für Kategorie 8 — Hypotheken und Darlehen, wenn es sich um natürlichen Personen gewährte Hypotheken und Darlehen handelt. — Dieses Element gilt nicht für CIC 71, CIC 75 und CIC-Kategorie 9 — Immobilien. |
| C0260 | Art des Codes der Emittentengruppe | <p>Angabe der Art des Codes, der im Element „Code der Emittentengruppe“ eingetragen wurde. Aus der folgenden erschöpfenden Liste ist eine Option auszuwählen:</p> <p>1 — Rechtsträgerkennung (LEI)</p> <p>9 — Keine Angabe</p> <p>Dieses Element gilt nicht für Kategorie 8 — Hypotheken und Darlehen, wenn es sich um natürlichen Personen gewährte Hypotheken und Darlehen handelt.</p> <p>Dieses Element gilt nicht für CIC 71, CIC 75 und CIC-Kategorie 9 — Immobilien.</p> |
| C0270 | Land des Emittenten | <p>Ländercode des Standorts des Emittenten gemäß ISO 3166–1 Alpha–2. Der Standort richtet sich nach der Anschrift des Emittenten.</p> <p>Dabei ist Folgendes zu beachten:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Im Hinblick auf die CIC-Kategorie 4 — Organismen für gemeinsame Anlagen wird das Land des Emittenten anhand des Fondsmanagers bestimmt. — Im Hinblick auf CIC-Kategorie 7 — Barmittel und Einlagen (ausgenommen CIC 71 und CIC 75) ist das Land des Emittenten das Land der Depotstelle. — Im Hinblick auf CIC 8 — Hypotheken und Darlehen, andere als Hypotheken und Darlehen an natürliche Personen, beziehen sich die Angaben auf den Darlehensnehmer. — Dieses Element gilt nicht für CIC 71, CIC 75 und CIC-Kategorie 9 — Immobilien. — Dieses Element gilt nicht für Kategorie 8 — Hypotheken und Darlehen, wenn es sich um natürlichen Personen gewährte Hypotheken und Darlehen handelt. <p>Eine der folgenden Optionen ist auszuwählen:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISO 3166–1 Alpha–2-Code — XA: Supranationale Emittenten — EU: Organe und Einrichtungen der Europäischen Union |
| C0280 | Währung | <p>Geben Sie den alphabetischen ISO-4217-Code der Währung an, in der die Emission erfolgt ist.</p> |

▼ B

| | ELEMENT | HINWEISE |
|-------|---------|--|
| | | <p>Dabei ist Folgendes zu beachten:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Dieses Element gilt nicht für CIC-Kategorie 8 — Hypotheken und Darlehen (für Hypotheken und Darlehen an natürliche Personen, da für diese Vermögenswerte kein Individualisierungsgebot besteht) und aus demselben Grund auch nicht für CIC 75 und CIC 95 — Anlagen (zur Eigennutzung). — Im Hinblick auf CIC-Kategorie 9, ausgenommen CIC 95, Anlagen (zur Eigennutzung), ist diejenige Währung anzugeben, in der die Investition erfolgte. |
| C0290 | CIC | Ergänzender Identifikationscode zur Klassifizierung der Vermögenswerte gemäß der CIC-Tabelle in Anhang VI der vorliegenden Verordnung. Wird ein Vermögenswert anhand der CIC-Tabelle klassifiziert, müssen die Unternehmen das repräsentativste Risiko berücksichtigen, dem der Vermögenswert ausgesetzt ist. |

▼ M4

| | | |
|-------|------------------------|--|
| C0292 | SCR-Berechnung bei OGA | <p>Aus der folgenden erschöpfenden Liste ist eine Option auszuwählen:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 - OGA, auf die gemäß Artikel 84 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/35 zur Berechnung der SCR ein vollständiger Look-through-Ansatz angewandt wurde; 2 - OGA, auf die gemäß Artikel 84 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/35 ein „vereinfachter“ Look-through-Ansatz auf der Grundlage der Zielallokation der Basiswerte oder der zuletzt gemeldeten Basiswertallokation angewandt wurde und für die Datengruppierungen verwendet wurden; 3 - OGA, auf die gemäß Artikel 84 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/35 ein „vereinfachter“ Look-through-Ansatz auf der Grundlage der Zielallokation der Basiswerte oder der zuletzt gemeldeten Basiswertallokation angewandt wurde und für die keine Daten-gruppierungen verwendet wurden; 4 - OGA, bei denen gemäß Artikel 168 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/35 der „Typ-2-Aktien“-Ansatz angewandt wurde; 9 - Entfällt <p>Die bei diesem Posten gewählte Antwort zum Look-through-Ansatz muss den zur Berechnung der SCR gewählten Ansatz widerspiegeln. Bei den Angaben zum Look-through-Ansatz in Meldebogen S. 06.03 sind die in den allgemeinen Bemerkungen zu diesem Meldebogen genannten Schwellenwerte zu berücksichtigen.</p> <p>Dieses Element gilt nur für CIC-Kategorie 4.</p> |
|-------|------------------------|--|

▼ M1

| | | |
|-------|--------------------------|---|
| C0300 | Infrastrukturinvestition | <p>Geben Sie an, ob es sich bei dem Vermögenswert um eine Infrastrukturinvestition im Sinne des Artikels 1 Absätze 55a und 55b der Delegierten Verordnung (EU) 2015/35 der Kommission handelt.</p> <p>Aus der folgenden erschöpfenden Liste ist eine Option auszuwählen:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Keine Infrastrukturinvestition |
|-------|--------------------------|---|

▼ **M1**

| | ELEMENT | HINWEISE |
|--|---------|---|
| | | <p>2 — Nichtqualifizierte Infrastruktur: Staatliche Garantie (der Regierung, der Zentralbank oder einer regionalen oder lokalen Gebietskörperschaft)</p> <p>3 — Nichtqualifizierte Infrastruktur: Staatliche Förderung einschließlich öffentlich-privater Partnerschaften (der Regierung, der Zentralbank oder einer regionalen oder lokalen Gebietskörperschaft)</p> <p>4 — Nichtqualifizierte Infrastruktur: Supranationale Garantie/Unterstützung (EZB, multilaterale Entwicklungsbank, internationale Organisation)</p> <p>9 — Nichtqualifizierte Infrastruktur: Sonstige nicht in die oben genannten Kategorien eingestufte nichtqualifizierte Infrastrukturdarlehen oder -investitionen</p> <p>12 — Qualifizierte Infrastruktur: Staatliche Garantie (der Regierung, der Zentralbank oder einer regionalen oder lokalen Gebietskörperschaft)</p> <p>13 — Qualifizierte Infrastruktur: Staatliche Förderung einschließlich öffentlich-privater Partnerschaften (der Regierung, der Zentralbank oder einer regionalen oder lokalen Gebietskörperschaft)</p> <p>14 — Qualifizierte Infrastruktur: Supranationale Garantie/Unterstützung (EZB, multilaterale Entwicklungsbank, internationale Organisation)</p> <p>19 — Qualifizierte Infrastruktur: Sonstige nicht in die oben genannten Kategorien eingestufte qualifizierte Infrastrukturinvestitionen</p> <p>20 — Europäischer langfristiger Investmentfonds (ELTIF, der in Infrastrukturvermögenswerte investiert, und ELTIF, der in andere — nicht infrastrukturbezogene — Vermögenswerte investiert)</p> |

▼ **B**

| | | |
|-------|--|---|
| C0310 | Anteile an verbundenen Unternehmen, einschließlich Beteiligungen | <p>Gilt nur für die Vermögenswertkategorien 3 und 4.</p> <p>Geben Sie an, ob es sich bei einem Eigenkapital- oder sonstigen Anteil um eine Beteiligung handelt. Aus der folgenden erschöpfenden Liste ist eine Option auszuwählen:</p> <p>► <u>M4</u> 1 — Keine Beteiligung</p> <p>2 — Beteiligung, auf die der Look-through-Ansatz nach Artikel 84 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/35 angewandt wird</p> <p>3 — Beteiligung, auf die der Look-through-Ansatz nach Artikel 84 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/35 nicht angewandt wird ◀</p> |
| C0320 | Externes Rating | <p>► <u>M2</u> Gilt zumindest für die CIC-Kategorien 1, 2, 5, 6 und 8 (Hypotheken und Darlehen außer Hypotheken und Darlehen an natürliche Personen), soweit vorhanden.</p> <p>Hierbei handelt es sich um das Emissionsrating für den Vermögenswert zum Berichtsstichtag, das von der benannten Ratingagentur (ECAI) vorgelegt wurde.</p> <p>Ist kein Emissionsrating verfügbar, ist das Feld „Element“ freizulassen. ◀</p> |
| C0330 | Benannte ECAI | <p>► <u>M2</u> Geben Sie anhand der folgenden erschöpfenden Liste den Namen der Ratingagentur an, die als benannte ECAI das externe Rating in C0320 vornimmt. Werden Ratings von Tochterunternehmen der ECAI ausgegeben, geben Sie die Mutter-ECAI an (siehe ESMA-Liste der registrierten oder zertifizierten Ratingagenturen entsprechend der Verordnung (EG) Nr. 1060/2009 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 16. September 2009 über Ratingagenturen). Wurde eine neue Ratingagentur von der ESMA registriert oder zertifiziert und die erschöpfende Liste noch nicht aktualisiert, geben Sie bitte „Sonstige benannte ECAI“ an.</p> |

▼ **B**

| | ELEMENT | HINWEISE |
|--|---------|---|
| | | <p>Gilt zumindest für die CIC-Kategorien 1, 2, 5, 6 und 8 (Hypotheken und Darlehen außer Hypotheken und Darlehen an natürliche Personen), soweit vorhanden. ◀</p> <p>► M4 — Euler Hermes Rating GmbH (LEI-Code: 391200QXGLWHK9VK6V27)</p> <p>— Japan Credit Rating Agency Ltd (LEI-Code: 35380002378CEGMRVW86)</p> <p>— BCRA-Credit Rating Agency AD (LEI-Code: 747800Z0IC3P66HTQ142)</p> <p>— Creditreform Rating AG (LEI-Code: 391200PHL11KDUTTST66)</p> <p>— Scope Ratings GmbH (LEI-Code: 391200WUIEZUQFHDWE91)</p> <p>— ICAP Group SA (LEI-Code: 2138008U6LKT8VG2UK85)</p> <p>— GBB-Rating Gesellschaft für Bonitätsbeurteilung GmbH (LEI-Code: 391200OLWXCTKPADVV72)</p> <p>— ASSEKURATA Assekuranz Rating-Agentur GmbH (LEI-Code: 529900977LETWLJF3295)</p> <p>— ARC Ratings, S.A. (LEI-Code: 213800OZNIQMV6UA7D79)</p> <p>— AM Best Europe</p> <p>— A.M. Best (EU) Rating Services B.V. (LEI-Code: 549300Z2RUKFKV7GON79)</p> <p>— AM Best Europe-Rating Services Ltd. (AMBERS) (LEI-Code: 549300VO8J8E5IQV1T26)</p> <p>— DBRS Ratings Limited (LEI-Code: 5493008CGCDQLGT3EH93)</p> <p>— Fitch</p> <p>— Fitch France S.A.S. (LEI-Code: 2138009Y4TCZT6QOJO69)</p> <p>— Fitch Deutschland GmbH (LEI-Code: 213800JEMOT1H45VN340)</p> <p>— Fitch Italia S.p.A. (LEI-Code: 213800POJ9QSCHL3KR31)</p> <p>— Fitch Polska S.A. (LEI-Code: 213800RYJTJPW2WD5704)</p> <p>— Fitch Ratings España S.A.U. (LEI-Code: 213800RENFHODKETE60)</p> <p>— Fitch Ratings Limited (LEI-Code: 2138009F8YAHVC8W3Q52)</p> <p>— Fitch Ratings CIS Limited (LEI-Code: 213800B7528Q4DIF2G76)</p> <p>— Moody's</p> <p>— Moody's Investors Service Cyprus Ltd (LEI-Code: 549300V4LCOYCMNUVR81)</p> <p>— Moody's France S.A.S. (LEI-Code: 549300EB2XQYRSE54F02)</p> <p>— Moody's Deutschland GmbH (LEI-Code: 549300M5JMGHVTWYZH47)</p> <p>— Moody's Italia S.r.l. (LEI-Code: 549300GMXJ4QK70UOU68)</p> <p>— Moody's Investors Service España S.A. (LEI-Code: 5493005X59ILY4BGJK90)</p> <p>— Moody's Investors Service Ltd (LEI-Code: 549300SM89WABHDNJ349)</p> <p>— Moody's Investors Service EMEA Ltd (LEI-Code: 54930009NU3JYS1HTT72)</p> <p>— Moody's Investors Service (Nordics) AB (LEI-Code: 549300W79ZVFWJCD2Z23)</p> <p>— Standard & Poor's</p> <p>— S&P Global Ratings Europe Limited (LEI-Code: 5493008B2TU3S6QE1E12)</p> <p>— CRIF Ratings S.r.l. (LEI-Code: 8156001AB6A1D740F237)</p> <p>— Capital Intelligence Ratings Ltd (LEI-Code: 549300RE88OJP9J24Z18)</p> |

▼ **B**

| | ELEMENT | HINWEISE |
|-------|---------------|--|
| | | <p>— European Rating Agency, a.s. (LEI-Code: 097900BFME0000038276)</p> <p>— Axesor Risk Management SL (LEI-Code: 959800EC2RH76JYS3844)</p> <p>— Cerved Rating Agency S.p.A. (LEI-Code: 8156004AB6C992A99368)</p> <p>— Kroll Bond Rating Agency (LEI-Code: 549300QYZ5CZYXTNZ676)</p> <p>— The Economist Intelligence Unit Ltd (LEI-Code: 213800Q7GRZWF95EWN10)</p> <p>— Dagong Europe Credit Rating Srl (Dagong Europe) (LEI-Code: 815600BF4FF53B7C6311)</p> <p>— Spread Research (LEI-Code: 969500HB6BVM2UJDOC52)</p> <p>— EuroRating Sp. z o.o. (LEI-Code: 25940027QWS5GMO74003)</p> <p>— HR Ratings de México, S.A. de C.V. (HR Ratings) (LEI-Code: 549300IFL3XJKTRHZ480)</p> <p>— Egan-Jones Ratings Co. (EJR) (LEI-Code: 54930016113PD33V1H31)</p> <p>— modeFinance S.r.l. (LEI-Code: 815600B85A94A0122614)</p> <p>— INC Rating Sp. z o.o. (LEI-Code: 259400SUBF5EPOGK0983)</p> <p>— Rating-Agentur Expert RA GmbH (LEI-Code: 213800P3OOBSGWN2UE81)</p> <p>— Kroll Bond Rating Agency Europe Limited (LEI-Code: 5493001NGHOLC41ZSK05)</p> <p>— Nordic Credit Rating AS (LEI-Code: 549300MLUDYVRQOOXS22)</p> <p>— DBRS Rating GmbH (LEI-Code: 54930033N1HPUEY7I370)</p> <p>— Beyond Ratings SAS (LEI-Code: 9695006ORIPPZ3QSM810)</p> <p>— Sonstige benannte ECAI</p> <p>— Es wurde keine ECAI benannt und zur Berechnung der SCR wird eine Vereinfachung angewandt ◀</p> <p>► M4 Diese Angabe ist zu übermitteln, wenn „Externes Rating“ (C0320) gemeldet wird. Im Falle der Angabe „Es wurde keine ECAI benannt und zur Berechnung der SCR wird eine Vereinfachung angewandt“ bleibt das Feld „Externes Rating“ (C0320) leer und ist bei „Bonitätsstufe“ (C0340) eine der folgenden Möglichkeiten auszuwählen: 2a; 3a oder 3b ◀</p> |
| C0340 | Bonitätsstufe | <p>► M2 Gilt für jeden Vermögenswert, der für die Zwecke der SCR-Berechnung einer Bonitätsstufe zugeordnet werden muss. ◀</p> <p>Geben Sie die Bonitätsstufe an, die dem Vermögenswert gemäß Artikel 109a Absatz 1 der Richtlinie 2009/138/EG zugewiesen wurde.</p> <p>Insbesondere muss die Bonitätsstufe ggf. intern erfolgte Bonitätsanpassungen durch Unternehmen, die die Standardformel verwenden, zum Ausdruck bringen.</p> <p>Dieses Element gilt nicht für Vermögenswerte, die von Unternehmen, die ein internes Modell verwenden, intern bewertet werden. Wenn Unternehmen, die ein internes Modell verwenden, keine interne Bewertung vornehmen, ist dieses Element zu berichten.</p> |

▼ **B**

| | ELEMENT | HINWEISE |
|-------|----------------------------------|--|
| | | <p>Aus der folgenden erschöpfenden Liste ist eine Option auszuwählen:</p> <p>► M4 0 — Bonitätsstufe 0</p> <p>1 — Bonitätsstufe 1</p> <p>2 — Bonitätsstufe 2</p> <p>2a — Bonitätsstufe 2 wegen Anwendung von Artikel 176a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/35 auf Anleihen und Darlehen ohne Rating</p> <p>3 — Bonitätsstufe 3</p> <p>3a — Bonitätsstufe 3 wegen Anwendung der vereinfachten Berechnung nach Artikel 105a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/35</p> <p>3b — Bonitätsstufe 3 wegen Anwendung von Artikel 176a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/35 auf Anleihen und Darlehen ohne Rating</p> <p>4 — Bonitätsstufe 4</p> <p>5 — Bonitätsstufe 5</p> <p>6 — Bonitätsstufe 6</p> <p>9 — Kein Rating verfügbar ◀</p> |
| C0350 | Internes Rating | <p>► M2 ————— ◀</p> <p>► M2 Gilt zumindest für die CIC-Kategorien 1, 2, 5, 6 und 8 (Hypotheken und Darlehen außer Hypotheken und Darlehen an natürliche Personen), soweit vorhanden. ◀</p> |
| C0360 | Laufzeit/Duration | <p>Gilt nur für die CIC-Kategorien 1, 2, 4 (sofern anwendbar, z. B. bei Organismen für gemeinsame Anlagen, die vorwiegend in Anleihen angelegt sind), 5 und 6.</p> <p>Kapitalbindungsdauer der Vermögenswerte, definiert als „modifizierte Restlaufzeit“ (berechnet anhand der vom Berichtsstichtag bis zum Fälligkeitstermin verbleibenden Zeit). Bei Vermögenswerten ohne festen Fälligkeitstermin ist der erste Kündigungstermin zu verwenden. Die Duration ist unter Zugrundelegung des wirtschaftlichen Werts zu berechnen.</p> |
| C0370 | Solvabilität-II-Preis je Einheit | <p>Betrag für den Vermögenswert in der Berichtswährung, sofern relevant.</p> <p>Dieses Element ist zu übermitteln, wenn im ersten Teil des Meldebogens unter „Angaben zu den gehaltenen Positionen“ eine „Menge“ (C0130) eingetragen wurde.</p> <p>Dieses Element ist nicht zu übermitteln, wenn das Element „Prozentualer Anteil des Nennwerts des Solvabilität-II-Preises je Einheit“ (C0380) gemeldet wird.</p> |

▼ B

| | ELEMENT | HINWEISE |
|-------|--|---|
| C0380 | Prozentualer Anteil des Nennwerts des Solvabilität-II-Preises je Einheit | <p>► M1 Betrag in Prozent des Nennwerts, Preis des Vermögenswerts ohne aufgelaufene Zinsen, sofern relevant.</p> <p>Dieses Element ist zu übermitteln, wenn im ersten Teil des Meldebogens unter „Angaben zu den gehaltenen Positionen“ ein „Nennwert“ (C0140) eingetragen wurde, außer für die CIC-Kategorien 71 und 9.</p> <p>Dieses Element ist nicht zu übermitteln, wenn das Element „Solvabilität-II-Preis je Einheit“ (C0370) gemeldet wird. ◀</p> |
| C0390 | Fälligkeitstermin | <p>Gilt nur für die CIC-Kategorien 1, 2, 5, 6 und 8, CIC 74 und CIC 79.</p> <p>Geben Sie den ISO 8601-Code (JJJJ-MM-TT) des Fälligkeitstermins an.</p> <p>Entspricht stets dem Fälligkeitstermin, auch bei kündbaren Wertpapieren.</p> <p>Dabei ist Folgendes zu beachten:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Bei Wertpapieren ohne bestimmte Fälligkeit (Perpetuals) ist „9999-12-31“ einzusetzen — Für CIC-Kategorie 8 — Darlehen und Hypotheken an Privatpersonen — ist die (anhand der Höhe des Darlehens) gewichtete Restlaufzeit zu melden. |

S.06.03 — Organismen für gemeinsame Anlagen — Look-Through-Ansatz**Allgemeine Bemerkungen:**

Dieser Abschnitt bezieht sich auf die vierteljährliche und die jährliche Übermittlung von Informationen für einzelne Unternehmen.

Dieser Meldebogen enthält anhand des Look-Through-Ansatzes ermittelte Informationen über Organismen für gemeinsame Anlagen oder Anlagen in Fondsform, einschließlich Angaben darüber, ob es sich um Beteiligungen handelt, nach Vermögenswertkategorie des Basiswerts, Ausgabeland und Währung. ► **M2** Unter Prüfung der Verhältnismäßigkeit und der speziellen Hinweise im Meldebogen ist der Look-Through-Ansatz so oft zu wiederholen, bis sämtliche Vermögenswertkategorien, Länder und Währungen erfasst sind. Im Falle von Dachfonds wird bei der Durchschau nach demselben Ansatz verfahren. ◀

▼ M3

Der Meldebogen enthält Angaben zu 100 % des Werts, der in Organismen für gemeinsame Anlagen investiert ist. In Bezug auf die Länderangaben ist allerdings der Look-Through-Ansatz zu verwenden, um die Risikoexpositionen in Höhe von 90 % des gesamten Fondswerts abzüglich der Beträge im Zusammenhang mit CIC 8 und 9 zu erfassen, und in Bezug auf Währungsangaben wird der Look-Through-Ansatz angewandt, um die Risikoexpositionen in Höhe von 90 % des gesamten Fondswerts zu erfassen. Die Unternehmen stellen sicher, dass die 10 %, die nicht nach Ländern aufgeschlüsselt sind, geografisch diversifiziert sind, sodass z. B. nicht mehr als 5 % auf ein einzelnes Land entfallen. Der Look-Through-Ansatz wird von Unternehmen unter Berücksichtigung des investierten Betrags angewandt, beginnend mit dem größten bis hin zum kleinsten Fonds, und muss im Zeitverlauf unverändert beibehalten werden.

▼ B

Vierteljährliche Angaben sind nur zu übermitteln, wenn die Organismen für gemeinsame Anlagen mehr als 30 % der Gesamtanlagen des Unternehmens ausmachen; als Maß gilt das Verhältnis zwischen den im Meldebogen S.02.01 unter C0010/R0180 aufgeführten Organismen für gemeinsame Anlagen zuzüglich der unter C0010/R0220 und C0010/R0090 desselben Meldebogens einbezogenen Organismen für gemeinsame Anlagen und der Summe der im selben Meldebogen unter C0010/R0070 und C0010/R0220 aufgeführten Werte.

Die Elemente sind als positive Werte zu berichten, sofern in den Hinweisen nichts anderes vorgegeben ist.

▼ B

Die in diesem Meldebogen aufgeführten Vermögenswertkategorien sind in Anhang IV der vorliegenden Verordnung niedergelegt; die hier aufgeführten CIC-Codes beziehen sich auf Anhang VI, der die Tabelle des Complementary Identification Code enthält.

| | ELEMENT | HINWEISE |
|-------|--|--|
| C0010 | ID-Code des Organismus für gemeinsame Anlagen | ID-Code des Vermögenswerts nach absteigender Priorität: — ISO 6166 ISIN, wenn verfügbar — Andere anerkannte Codes (z. B.: CUSIP, Bloomberg Ticker, Reuters RIC) — Vom Unternehmen vergebener Code, wenn die vorstehenden Optionen nicht verfügbar sind, dieser Code muss im Zeitverlauf unverändert beibehalten werden. |
| C0020 | Art des ID-Codes des Organismus für gemeinsame Anlagen | Art des ID-Codes, der für das Element „ID-Code des Vermögenswerts“ verwendet wird. Aus der folgenden erschöpfenden Liste ist eine Option auszuwählen: 1 — ISO 6166 ISIN 2 — CUSIP (die vom Service Bureau des Committee on Uniform Securities Identification Procedures, CUSIP, für US-amerikanische und kanadische Unternehmen vergebene Nummer) 3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List für die London Stock Exchange) 4 — WKN (Wertpapierkennnummer, die alphanumerische ID in Deutschland) 5 — Bloomberg Ticker (die von Bloomberg vergebene Buchstabenkennung für Finanztitel) 6 — BBGID (Bloomberg Global ID) 7 — Reuters RIC (Reuters Instrument Code) 8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier) 9 — Andere von Mitgliedern der Association of National Numbering Agencies vergebene Kennung 99 — Vom Unternehmen vergebener Code |
| C0030 | Kategorie des zugrundeliegenden Vermögenswerts | Geben Sie die im Organismus für gemeinsame Anlagen enthaltenen Vermögenswertkategorien, Forderungen und Derivate an. Aus der folgenden erschöpfenden Liste ist eine Option auszuwählen: 1 — Staatsanleihen 2 — Unternehmensanleihen 3L — Notierte Aktien 3X — Nicht notierte Aktien 4 — Organismen für gemeinsame Anlagen 5 — Strukturierte Schuldtitel 6 — Besicherte Wertpapiere 7 — Barmittel und Einlagen 8 — Hypotheken und Darlehen 9 — Immobilien 0 — Sonstige Anlagen (einschließlich Forderungen) A — Futures B — Kaufoptionen C — Verkaufsoptionen D — Swaps |

▼ **B**

| | ELEMENT | HINWEISE |
|-------|--------------|---|
| | | <p>E — Forwards F — Kreditderivate L — Verbindlichkeiten</p> <p>► M2 Sowohl bei „Dachfonds“ als auch bei anderen Fonds ist Kategorie „4 — Organismen für gemeinsame Anlagen“ ausschließlich für nicht wesentliche Restwerte zu verwenden. ◀</p> |
| C0040 | Ausgabeland | <p>Aufschlüsselung aller unter C0030 angegebenen Vermögenswertkategorien nach Ausgabeländern. Geben Sie den Standort des Emittenten an. Der Standort richtet sich nach der Anschrift des Emittenten.</p> <p>Eine der folgenden Optionen ist auszuwählen:</p> <ul style="list-style-type: none"> — ISO 3166-1 Alpha-2-Code — XA: Supranationale Emittenten — EU: Organe und Einrichtungen der Europäischen Union — AA: Aggregierte Länder unterhalb der Wesentlichkeitsschwelle <p>Dieses Element gilt nicht für die unter C0030 übermittelten Kategorien 8 und 9.</p> |
| C0050 | Währung | <p>► M3 Geben Sie an, ob es sich bei der Währung der Vermögenswertkategorie um die Berichtswährung oder um eine Fremdwährung handelt. Als Fremdwährungen gelten alle anderen Währungen als die Berichtswährung. Aus der folgenden erschöpfenden Liste ist eine Option auszuwählen:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — Berichtswährung 2 — Fremdwährung 3 — Aggregierte Währungen unterhalb der Wesentlichkeitsschwelle ◀ |
| C0060 | Gesamtbetrag | <p>Durch Organismen für gemeinsame Anlagen investierter Gesamtbetrag nach Vermögenswertkategorien, Ländern und Währungen.</p> <p>► M2 Verbindlichkeiten sind als positive Werte auszuweisen, es sei denn, es handelt sich um eine derivative Verbindlichkeit. ◀</p> <p>Für Derivate kann ein positiver (bei Vermögenswerten) oder negativer (bei Verbindlichkeiten) Gesamtbetrag angegeben werden.</p> |