

S.37.01 — Risikokonzentration**Allgemeine Bemerkungen:**

Dieser Abschnitt bezieht sich auf die jährliche Übermittlung von Informationen für Gruppen.

In diesem Meldebogen sind alle erheblichen Risikokonzentrationen zwischen den in den Umfang der Gruppenaufsicht einbezogenen Unternehmen und Dritten anzugeben, unabhängig davon, welche Berechnungsmethode verwendet wird oder ob branchenspezifische Vorschriften für die Berechnung der Gruppensolvabilität verwendet wurden.

Das Ziel ist die Angabe der wichtigsten Risikoexponierung (Wert der Exponierung) nach Gegenpartei und nach Art der Risikoexponierung (Gruppe und/oder Unternehmen) außerhalb des Umfangs der Rückversicherungsgruppe/ Versicherungsgruppe (maximale Risikoexposition pro Vertrag und bei Ausfall eines Rückversicherers die außerbilanzielle Risikokonzentration). Diese ist als maximal mögliche Exponierung aus einem Vertrag zu verstehen und spiegelt sich nicht unbedingt in der Bilanz wider, trägt jedoch keinen risikomindernden Instrumenten oder Techniken Rechnung. Schwellenwerte können durch die für die Gruppenaufsicht zuständige Behörde nach Konsultation der Gruppe und des Kollegiums festgelegt werden.

▼ B

	ELEMENT	HINWEISE
C0010	Name der externen Gegenpartei	Dies ist der Name der externen Gegenpartei der Gruppe.
C0020	Identifikationscode der Gegenpartei der Gruppe	Die dem Emittenten/ Käufer/ Erwerber zugewiesene Rechtsträgerkennung (LEI), sofern vorhanden. Liegt kein solcher Code vor, ist dieses Element nicht zu berichten.
C0030	Art des ID-Codes der Gegenpartei der Gruppe	Art des im Element „Identifikationscode der Gegenpartei der Gruppe“ angegebenen Codes. 1 — LEI 9 — Nicht verfügbar
C0040	Land, in dem die Risikoexponierung besteht	Anzugeben ist der Alpha-2-Code nach ISO 3166-1 des Landes, in dem die Risikoexponierung besteht. Bei einem Emittenten einer Anleihe ist dies z. B. das Land, in dem das Unternehmen, das die Anleihe emittiert, seinen Hauptsitz hat.
C0050	Art der Risikoexponierung	Beschreibung der Art der Risikoexponierung. Derivate und Sicherheiten sind ebenso wie Risikoexponierungen gegenüber Gegenparteien einzubeziehen. Ist mehr als eine Art der Risikoexponierung pro Gegenpartei vorhanden, sind diese in Form von separaten Einträgen in separaten Zeilen aufzuführen. Aus der folgenden erschöpfenden Liste ist eine Option auszuwählen:: 1 — Vermögenswerte — Anleihen 2 — Vermögenswerte — Eigenkapital 3 — Vermögenswert — Rückversicherung 4 — Vermögenswerte — sonstige 5 — Verbindlichkeiten — Versicherung 6 — Verbindlichkeiten — Anleihen 7 — Verbindlichkeiten — Schulden 8 — Verbindlichkeit — sonstige 9 — Außerbilanzielle Posten (Eventualvermögenswerte) 10 — Außerbilanzielle Posten (Eventualverbindlichkeiten) Derivate sind nach Abzug von Sicherheiten anzugeben.
C0060	Identifikationscode der Risikoexponierung	ID-Code der Risikoexponierung 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 ist im Zeitverlauf unverändert beizubehalten. Bei Typ-3- und Typ-5-Risikoexponierungen muss die Meldung in C0050 nach Gegenpartei erfolgen, und es ist kein Wert in dieser Zelle zu übermitteln.
C0070	Art des Identifikationscodes der Risikoexponierung	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

▼ **B**

	ELEMENT	HINWEISE
		<p>2 — CUSIP (die vom Service Bureau des Committee on Uniform Securities Identification Procedures, CUSIP, für US-amerikanische und kanadische Unternehmen vergebene Nummer)</p> <p>3 — SEDOL (Stock Exchange Daily Official List für die London Stock Exchange)</p> <p>4 — WKN (Wertpapierkennnummer, die alphanumerische ID in Deutschland)</p> <p>5 — Bloomberg Ticker (die von Bloomberg vergebene Buchstabenkennung für Finanztitel)</p> <p>6 — BBGID (Bloomberg Global ID)</p> <p>7 — Reuters RIC (Reuters Instrument Code)</p> <p>8 — FIGI (Financial Instrument Global Identifier)</p> <p>9 — Andere von Mitgliedern der Association of National Numbering Agencies vergebene Kennung</p> <p>99 — Vom Unternehmen vergebener Code</p> <p>Bei Typ-3- und Typ-5-Risikoexponierungen muss die Meldung in C0050 nach Gegenpartei erfolgen, und es ist kein Wert in dieser Zelle zu übermitteln.</p> <p>Besteht eine bestimmte Risikoexponierung aus mehr als einem Code, ist jeder Code in einer separaten Zeile aufzuführen.</p>
C0080	Externes Rating	Bewertung der Risikoexposition durch die benannte Ratingagentur (ECAI) zum Berichtsstichtag.
C0090	Benannte ECAI	<p>► M2 Geben Sie anhand der folgenden erschöpfenden Liste den Namen der Ratingagentur an, die als benannte ECAI das externe Rating in C0080 vornimmt. Werden Ratings von Tochterunternehmen der ECAI ausgegeben, geben Sie bitte 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). ► M3 Werden Ratings von Tochterunternehmen der ECAI ausgegeben, geben Sie bitte 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). ◀ ◀</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: 391200WU1EZUQFHDWE91)</p> <p>— ICAP Group SA (LEI-Code: 2138008U6LKT8VG2UK85)</p> <p>— GBB-Rating Gesellschaft für Bonitätsbeurteilung GmbH (LEI-Code: 391200OLWXCTKPADVV72)</p>

▼B

	ELEMENT	HINWEISE
		<ul style="list-style-type: none"> — ASSEKURATA Assekuranz Rating-Agentur GmbH (LEI-Code: 529900977LETWLJF3295) — ARC Ratings, S.A. (LEI-Code: 213800OZNIQMV6UA7D79) — AM Best Europe — A.M. Best (EU) Rating Services B.V. (LEI-Code: 549300Z2RUKFKV7GON79) — AM Best Europe-Rating Services Ltd. (AMBERS) (LEI-Code: 549300VO8J8E5IQV1T26) — DBRS Ratings Limited (LEI-Code: 5493008CGCDQLGT3EH93) — Fitch — Fitch France S.A.S. (LEI-Code: 2138009Y4TCZT6QOJO69) — Fitch Deutschland GmbH (LEI-Code: 213800JEMOT1H45VN340) — Fitch Italia S.p.A. (LEI-Code: 213800POJ9QSCHL3KR31) — Fitch Polska S.A. (LEI-Code: 213800RYJTJPW2WD5704) — Fitch Ratings España S.A.U. (LEI-Code: 213800RENFIIODKETE60) — Fitch Ratings Limited (LEI-Code: 2138009F8YAHVC8W3Q52) — Fitch Ratings CIS Limited (LEI-Code: 213800B7528Q4DIF2G76) — Moody's — Moody's Investors Service Cyprus Ltd (LEI-Code: 549300V4LCOYCMNUVR81) — Moody's France S.A.S. (LEI-Code: 549300EB2XQYRSE54F02) — Moody's Deutschland GmbH (LEI-Code: 549300M5JMGHVTWYZH47) — Moody's Italia S.r.l. (LEI-Code: 549300GMXJ4QK70UOU68) — Moody's Investors Service España S.A. (LEI-Code: 5493005X59ILY4BGJK90) — Moody's Investors Service Ltd (LEI-Code: 549300SM89WABHDNJ349) — Moody's Investors Service EMEA Ltd (LEI-Code: 54930009NU3JYS1HTT72) — Moody's Investors Service (Nordics) AB (LEI-Code: 549300W79ZVFWJCD2Z23) — Standard & Poor's — S&P Global Ratings Europe Limited (LEI-Code: 5493008B2TU3S6QE1E12) — CRIF Ratings S.r.l. (LEI-Code: 8156001AB6A1D740F237) — Capital Intelligence Ratings Ltd (LEI-Code: 549300RE88OJP9J24Z18) — European Rating Agency, a.s. (LEI-Code: 097900BFME0000038276) — Axesor Risk Management SL (LEI-Code: 959800EC2RH76JYS3844) — Cerved Rating Agency S.p.A. (LEI-Code: 8156004AB6C992A99368) — Kroll Bond Rating Agency (LEI-Code: 549300QYZ5CZYXTNZ676) — The Economist Intelligence Unit Ltd (LEI-Code: 213800Q7GRZWF95EWN10)

▼ B

	ELEMENT	HINWEISE
		<ul style="list-style-type: none"> — Dagong Europe Credit Rating Srl (Dagong Europe) (LEI-Code: 815600BF4FF53B7C6311) — Spread Research (LEI-Code: 969500HB6BVM2UJDOC52) — EuroRating Sp. z o.o. (LEI-Code: 25940027QWS5GMO74003) — HR Ratings de México, S.A. de C.V. (HR Ratings) (LEI-Code: 549300IFL3XJKTRHZ480) — Egan-Jones Ratings Co. (EJR) (LEI-Code: 54930016113PD33V1H31) — modeFinance S.r.l. (LEI-Code: 815600B85A94A0122614) — INC Rating Sp. z o.o. (LEI-Code: 259400SUBF5EPOGK0983) — Rating-Agentur Expert RA GmbH (LEI-Code: 213800P3OOBSGWN2UE81) — Kroll Bond Rating Agency Europe Limited (LEI-Code: 5493001NGHOLC41ZSK05) — Nordic Credit Rating AS (LEI-Code: 549300MLUDYVRQOOXS22) — DBRS Rating GmbH (LEI-Code: 54930033N1HPUEY7I370) — Beyond Ratings SAS (LEI-Code: 9695006ORIPPZ3QSM810) — Sonstige benannte ECAI ◀

▼ M3

C0091	Internes Rating	Internes Rating der Risikoexposition für Unternehmen, die ein internes Modell verwenden, soweit die internen Ratings in ihre interne Modellierung einfließen. Wenn für die interne Modellierung des Unternehmens lediglich externe Ratings herangezogen werden, ist dieses Element nicht zu übermitteln.
-------	-----------------	--

▼ B

C0100	Sektor	Geben Sie den Wirtschaftszweig des Emittenten anhand des aktuell gültigen NACE-Codes an. Die Buchstabenkennung, die für den NACE-Abschnitt steht, sollte als Mindestangabe für den Wirtschaftszweig verwendet werden (so wäre z. B. „A“ oder „A0111“ angemessen); wenn sich der NACE-Code allerdings auf die Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen bezieht, sollte dem Buchstaben für den Abschnitt noch der vierstellige numerische Code der NACE-Klasse (z. B. „K6411“) beigefügt werden.
C0110	Unternehmen der Gruppe, das dem Risiko ausgesetzt ist	Auflistung aller beteiligten Unternehmen in der Gruppe, die dem Risiko ausgesetzt sind. Dies betrifft alle Unternehmen, und für jedes Unternehmen ist ein separater Eintrag zu übermitteln. Ist mehr als ein Unternehmen der Gruppe beteiligt, ist für jedes Unternehmen eine separate Zeile zu verwenden.
C0120	Identifikationscode des Unternehmens der Gruppe	Der eindeutige Identifikationscode wie im Meldebogen S.32.01 angegeben. Identifikationscode in dieser Rangfolge: — Rechtsträgerkennung (LEI); — Spezifischer Code Spezifischer Code: — für Versicherungs- oder Rückversicherungsunternehmen mit Sitz im EWR und sonstige der Aufsicht unterliegende Unternehmen im EWR, die in die Gruppenaufsicht einbezogen sind: der auf dem lokalen Markt verwendete Identifikationscode, der durch die Aufsichtsbehörde des Unternehmens zugewiesen wird;

▼ B

	ELEMENT	HINWEISE
		<p>— für außerhalb des EWR ansässige Unternehmen und nicht regulierte Unternehmen, die in die Gruppenaufsicht einbezogen sind, wird der von der Gruppe zugewiesene Identifikationscode verwendet. Bei der Vergabe eines Identifikationscodes an außerhalb des EWR ansässige oder nicht der Aufsicht unterliegende Unternehmen sollte die Gruppe durchgängig folgendes Format einhalten:</p> <p>Identifikationscode des Mutterunternehmens + ISO 3166-1 Alpha-2-Code des Landes des Unternehmens + fünfstellige Zahl</p>
C0130	Art des ID-Codes des Unternehmens der Gruppe	<p>Art des im Element „Identifikationscode des Unternehmens der Gruppe“ angegebenen Codes.</p> <p>1 — Rechtsträgerkennung (LEI)</p> <p>2 — Spezifischer Code</p>
C0140	Fälligkeit (Aktivseite)/ Gültigkeit (Passivseite)	<p>Geben Sie den ISO-8601-Code (JJJJ-MM-TT) des Datums an, an dem die Vermögenswerte fällig und die Verbindlichkeiten wirksam werden. Für das Fälligkeitsdatum der Vermögenswerte und das Gültigkeitsdatum der Verbindlichkeiten sollte ein festes Datum angegeben werden, das als vertragliches Beendigungsdatum oder als letzten Punkt der Zahlungsstromprojektion zu verstehen ist, je nachdem, welcher Zeitpunkt eher eintritt.</p> <p>Ist mehr als ein Fälligkeitsdatum anwendbar, so ist jedes Fälligkeitsdatum in einer separaten Zeile aufzuführen.</p>
C0150	Wert der Risikoexponierung	<p>Der Solvabilität-II-Wert der Risikoexponierung zum Berichtsdatum für bilanzielle Risikoexponierungen (Code 1 bis 8 aus C0050) und der maximale potenzielle Wert, wenn möglich, unabhängig von ihrer Wahrscheinlichkeit für außerbilanzielle Positionen (Code 9 bis 10 aus C0050).</p> <p>Dieser Wert ist auch auf Rückversicherungsverträge anwendbar:</p> <p>— Bei zedierten Rückversicherungen ist der Betrag der aus Rückversicherungen einforderbaren Beträge zu melden.</p> <p>— Bei dem in Rückdeckung übernommenen Geschäft ist der Betrag der versicherungstechnischen Rückstellungen zu melden.</p>
C0160	Währung	Geben Sie den alphabetischen ISO-4217-Code der ursprünglichen Währung der betreffenden Exponierung an.
C0170	Vom Rückversicherer zu zahlender Höchstbetrag	Nur anwendbar, wenn die Risikoexponierung „Vermögenswerte — Rückversicherung“ entspricht: Falls der Rückversicherer Leistungen aus einem Rückversicherungsvertrag erbringen muss, ist dies der vom Rückversicherer an die Vertragspartei unter Berücksichtigung der Besonderheiten im Rückversicherungsbetrag zu zahlende Höchstbetrag.