

Anhang I der Durchführungsverordnung (EU) 2015/2450 der Kommission wird wie folgt geändert:

1) S.26.01.01 erhält folgende Fassung:

„S.26.01.01

Solvenzkapitalanforderung — Marktrisiko

Artikel 112 **Z0010**

Anwendung von Vereinfachungen

C0010

Vereinfachungen — Spread-Risiko — Anleihen und Darlehen **R0010**

Vereinfachungen für firmeneigene Versicherungsunternehmen — Zinsrisiko **R0020**

Vereinfachungen für firmeneigene Versicherungsunternehmen — Spread-Risiko von Anleihen und Darlehen **R0030**

Vereinfachungen für firmeneigene Versicherungsunternehmen — Marktrisikokonzentration **R0040**

	Absolute Ausgangswerte vor Schock		Absolute Werte nach Schock				
	Vermögenswerte	Verbindlichkeiten	Vermögenswerte	Verbindlichkeiten (nach Verlustausgleichsfähigkeit der versicherungstechnischen Rückstellungen)	Netto-Solvenzkapitalanforderung	Verbindlichkeiten (vor Verlustausgleichsfähigkeit der versicherungstechnischen Rückstellungen)	Brutto-Solvenzkapitalanforderung
	C0020	C0030	C0040	C0050	C0060	C0070	C0080
Marktrisiko — Basisinformationen							
Zinsrisiko							
Zinsrückgangsschock							
Zinsanstiegsschock							
Aktienrisiko							
Typ-1-Aktien							
Investition in Typ-1-Aktien							
strategische Beteiligungen (Typ-1-Aktien)							
durationsbasiert (Typ-1-Aktien)							

Absolute Ausgangswerte vor Schock		Absolute Werte nach Schock				
Vermögenswerte	Verbindlichkeiten	Vermögenswerte	Verbindlichkeiten (nach Verlustausgleichsfähigkeit der versicherungstechnischen Rückstellungen)	Netto-Solvvenzkapitalanforderung	Verbindlichkeiten (vor Verlustausgleichsfähigkeit der versicherungstechnischen Rückstellungen)	Brutto-Solvvenzkapitalanforderung
C0020	C0030	C0040	C0050	C0060	C0070	C0080
Marktrisiko — Basisinformationen						
Typ-2-Aktien						
Investition in Typ-2-Aktien						
strategische Beteiligungen (Typ-2-Aktien)						
durationsbasiert (Typ-2-Aktien)						
qualifizierte Eigenkapitalinvestitionen in Infrastruktur						
Immobilienrisiko						

Absolute Ausgangswerte vor Schock		Absolute Werte nach Schock				
Vermögenswerte	Verbindlichkeiten	Vermögenswerte	Verbindlichkeiten (nach Verlustausgleichsfähigkeit der versicherungstechnischen Rückstellungen)	Netto-Solvvenzkapitalanforderung	Verbindlichkeiten (vor Verlustausgleichsfähigkeit der versicherungstechnischen Rückstellungen)	Brutto-Solvvenzkapitalanforderung
C0020	C0030	C0040	C0050	C0060	C0070	C0080
Marktrisiko — Basisinformationen						
Spread-Risiko						
Anleihen und Darlehen						
Anleihen und Darlehen (qualifizierte Infrastrukturinvestitionen)						
Anleihen und Darlehen (ausgenommen qualifizierte Infrastrukturinvestitionen)						
Kreditderivate						
Rückgangsschock bei Kreditderivaten						
Anstiegsschock bei Kreditderivaten						

Absolute Ausgangswerte vor Schock		Absolute Werte nach Schock						
		Vermögenswerte	Verbindlichkeiten	Vermögenswerte	Verbindlichkeiten (nach Verlustausgleichsfähigkeit der versicherungstechnischen Rückstellungen)	Netto-Solvvenzkapitalanforderung	Verbindlichkeiten (vor Verlustausgleichsfähigkeit der versicherungstechnischen Rückstellungen)	Brutto-Solvvenzkapitalanforderung
		C0020	C0030	C0040	C0050	C0060	C0070	C0080
Marktrisiko — Basisinformationen								
Verbriefungspositionen	R0450							
Typ-1-Verbriefungen	R0460							
Typ-2-Verbriefungen	R0470							
Wiederverbriefungen	R0480							
Marktrisikokonzentrationen	R0500							
Währungsrisiko	R0600							
Aufwertung der Fremdwährung	R0610							
Abwertung der Fremdwährung	R0620							
Diversifikation innerhalb des Marktrisikomoduls	R0700							
Gesamtes Marktrisiko	R0800							5

2) S.26.01.04 erhält folgende Fassung:

„S.26.01.04

Solvenzkapitalanforderung — Marktrisiko

Artikel 112 **Z0010**

Anwendung von Vereinfachungen

C0010

Vereinfachungen — Spread-Risiko — Anleihen und Darlehen **R0010**

Vereinfachungen für firmeneigene Versicherungsunternehmen — Zinsrisiko **R0020**

Vereinfachungen für firmeneigene Versicherungsunternehmen — Spread-Risiko von Anleihen und Darlehen **R0030**

Vereinfachungen für firmeneigene Versicherungsunternehmen — Marktrisikokonzentration **R0040**

Marktrisiko — Basisinformationen

Zinsrisiko

Zinsrückgangsschock

Zinsanstiegsschock

Aktienrisiko

Typ-1-Aktien

Investition in Typ-1-Aktien

strategische Beteiligungen (Typ-1-Aktien)

durationsbasiert (Typ-1-Aktien)

Typ-2-Aktien

Investition in Typ-2-Aktien

Absolute Ausgangswerte vor Schock		Absolute Werte nach Schock				
Vermögenswerte	Verbindlichkeiten	Vermögenswerte	Verbindlichkeiten (nach Verlustausgleichsfähigkeit der versicherungstechnischen Rückstellungen)	Netto-Solvenzkapitalanforderung	Verbindlichkeiten (vor Verlustausgleichsfähigkeit der versicherungstechnischen Rückstellungen)	Brutto-Solvenzkapitalanforderung
C0020	C0030	C0040	C0050	C0060	C0070	C0080
R0100						
R0110						
R0120						
R0200						
R0210						
R0220						
R0230						
R0240						
R0250						
R0260						

Marktrisiko — Basisinformationen
 strategische Beteiligungen (Typ-2-Aktien)
 durationsbasiert (Typ-2-Aktien)
 qualifizierte Eigenkapitalinvestitionen in Infrastruktur
 Immobilienrisiko

	Absolute Ausgangswerte vor Schock		Absolute Werte nach Schock				
	Vermögenswerte	Verbindlichkeiten	Vermögenswerte	Verbindlichkeiten (nach Verlustausgleichsfähigkeit der versicherungstechnischen Rückstellungen)	Netto-Solvvenzkapitalanforderung	Verbindlichkeiten (vor Verlustausgleichsfähigkeit der versicherungstechnischen Rückstellungen)	Brutto-Solvvenzkapitalanforderung
	C0020	C0030	C0040	C0050	C0060	C0070	C0080
R0270							
R0280							
R0290							
R0300							

Marktrisiko — Basisinformationen
 Spread-Risiko
 Anleihen und Darlehen
 Anleihen und Darlehen (qualifizierte Infrastrukturinvestitionen)
 Anleihen und Darlehen (ausgenommen qualifizierte Infrastrukturinvestitionen)
 Kreditderivate
 Rückgangsschock bei Kreditderivaten
 Anstiegsschock bei Kreditderivaten
 Verbriefungspositionen
 Typ-1-Verbriefungen

	Absolute Ausgangswerte vor Schock		Absolute Werte nach Schock				
	Vermögenswerte	Verbindlichkeiten	Vermögenswerte	Verbindlichkeiten (nach Verlustausgleichsfähigkeit der versicherungstechnischen Rückstellungen)	Netto-Solvvenzkapitalanforderung	Verbindlichkeiten (vor Verlustausgleichsfähigkeit der versicherungstechnischen Rückstellungen)	Brutto-Solvvenzkapitalanforderung
	C0020	C0030	C0040	C0050	C0060	C0070	C0080
R0400							
R0410							
R0411							
R0412							
R0420							
R0430							
R0440							
R0450							
R0460							

Absolute Ausgangswerte vor Schock		Absolute Werte nach Schock						
		Vermögenswerte	Verbindlichkeiten	Vermögenswerte	Verbindlichkeiten (nach Verlustausgleichsfähigkeit der versicherungstechnischen Rückstellungen)	Netto-Solvenzkapitalanforderung	Verbindlichkeiten (vor Verlustausgleichsfähigkeit der versicherungstechnischen Rückstellungen)	Brutto-Solvenzkapitalanforderung
		C0020	C0030	C0040	C0050	C0060	C0070	C0080
Marktrisiko — Basisinformationen								
Typ-2-Verbriefungen	R0470							
Wiederverbriefungen	R0480							
Marktrisikokonzentrationen	R0500							
Währungsrisiko	R0600							
Aufwertung der Fremdwährung	R0610							
Abwertung der Fremdwährung	R0620							
Diversifikation innerhalb des Marktrisikomoduls	R0700							
Gesamtes Marktrisiko	R0800							"

3) SR.26.01.01 erhält folgende Fassung:

„SR.26.01.01

Solvenzkapitalanforderung — Marktrisiko

Artikel 112	Z0010	<input type="text"/>
Sonderverband/Matching-Adjustment-Portfolio oder übriger Teil	Z0020	<input type="text"/>
Fonds-/Portfolionummer	Z0030	<input type="text"/>

Anwendung von Vereinfachungen

C0010

Vereinfachungen — Spread-Risiko — Anleihen und Darlehen	R0010	<input type="text"/>
Vereinfachungen für firmeneigene Versicherungsunternehmen — Zinsrisiko	R0020	<input type="text"/>
Vereinfachungen für firmeneigene Versicherungsunternehmen — Spread-Risiko von Anleihen und Darlehen	R0030	<input type="text"/>
Vereinfachungen für firmeneigene Versicherungsunternehmen — Marktrisikokonzentration	R0040	<input type="text"/>

		Absolute Ausgangswerte vor Schock		Absolute Werte nach Schock				
		Vermögenswerte	Verbindlichkeiten	Vermögenswerte	Verbindlichkeiten (nach Verlustausgleichsfähigkeit der versicherungstechnischen Rückstellungen)	Netto-Solvvenzkapitalanforderung	Verbindlichkeiten (vor Verlustausgleichsfähigkeit der versicherungstechnischen Rückstellungen)	Brutto-Solvvenzkapitalanforderung
Marktrisiko — Basisinformationen		C0020	C0030	C0040	C0050	C0060	C0070	C0080
Zinsrisiko	R0100							
Zinsrückgangsschock	R0110							
Zinsanstiegsschock	R0120							
Aktienrisiko	R0200							
Typ-1-Aktien	R0210							
Investition in Typ-1-Aktien	R0220							
strategische Beteiligungen (Typ-1-Aktien)	R0230							
durationsbasiert (Typ-1-Aktien)	R0240							
Typ-2-Aktien	R0250							
Investition in Typ-2-Aktien	R0260							
strategische Beteiligungen (Typ-2-Aktien)	R0270							
durationsbasiert (Typ-2-Aktien)	R0280							
qualifizierte Eigenkapitalinvestitionen in Infrastruktur	R0290							
Immobilienrisiko	R0300							

		Absolute Ausgangswerte vor Schock		Absolute Werte nach Schock				
		Vermögenswerte	Verbindlichkeiten	Vermögenswerte	Verbindlichkeiten (nach Verlustausgleichsfähigkeit der versicherungstechnischen Rückstellungen)	Netto-Solvvenzkapitalanforderung	Verbindlichkeiten (vor Verlustausgleichsfähigkeit der versicherungstechnischen Rückstellungen)	Brutto-Solvvenzkapitalanforderung
		C0020	C0030	C0040	C0050	C0060	C0070	C0080
Marktrisiko — Basisinformationen								
Spread-Risiko	R0400							
Anleihen und Darlehen	R0410							
Anleihen und Darlehen (qualifizierte Infrastrukturinvestitionen)	R0411							
Anleihen und Darlehen (ausgenommen qualifizierte Infrastrukturinvestitionen)	R0412							
Kreditderivate	R0420							
Rückgangsschock bei Kreditderivaten	R0430							
Anstiegsschock bei Kreditderivaten	R0440							
Verbriefungspositionen	R0450							
Typ-1-Verbriefungen	R0460							
Typ-2-Verbriefungen	R0470							
Wiederverbriefungen	R0480							
Marktrisikokonzentrationen	R0500							
Währungsrisiko	R0600							
Aufwertung der Fremdwährung	R0610							
Abwertung der Fremdwährung	R0620							
Diversifikation innerhalb des Marktrisikomoduls	R0700							
Gesamtes Marktrisiko	R0800							"