

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 | | | | | | | | | | |
| Quote der Solvenzkapitalanforderung | R0120 | | | | | | | | | | |
| Quote der Mindestkapitalanforderung | R0130 | | | | | | | | | | |

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 Solvenzkapitalanforderung anrechnungsfähige Eigenmittel | R0050 | | | | | | | | | | |
| Tier 1 | R0060 | | | | | | | | | | |
| Tier 2 | R0070 | | | | | | | | | | |
| Tier 3 | R0080 | | | | | | | | | | |
| Solvenzkapitalanforderung | R0090 | | | | | | | | | | |
| Quote der Solvenzkapitalanforderung | R0120 | | | | | | | | | | |
| Quote der Mindestkapitalanforderung | R0130 | | | | | | | | | | |

SR.22.02.01

Projektion der künftigen Zahlungsströme (besten Schätzwert — Matching-Portfolios)

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

| | | Projektion der künftigen Zahlungsströme am Ende des Berichtszeitraums | | | Inkongruenz im Berichtszeitraum | |
|---|-------|---|-------------------------------------|---|--|--|
| | | Zahlungsabflüsse durch Verpflichtungen aufgrund von 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) | | X | X | X | X | X |
| 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 | | | | | |

| | | Projektion der künftigen Zahlungsströme am Ende des Berichtszeitraums | | | Inkongruenz im Berichtszeitraum | |
|--|--------------|---|-------------------------------------|---|--|--|
| | | Zahlungsabflüsse durch Verpflichtungen aufgrund von 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) | | | | | | |
| 14 | R0140 | | | | | |
| 15 | R0150 | | | | | |
| 16 | R0160 | | | | | |
| 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 | | | | | |

| | | Projektion der künftigen Zahlungsströme am Ende des Berichtszeitraums | | | Inkongruenz im Berichtszeitraum | |
|--|--------------|---|-------------------------------------|---|--|--|
| | | Zahlungsabflüsse durch Verpflichtungen aufgrund von 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) | | | | | | |
| 30 | R0300 | | | | | |
| 31 | R0310 | | | | | |
| 32 | R0320 | | | | | |
| 33 | R0330 | | | | | |
| 34 | R0340 | | | | | |
| 35 | R0350 | | | | | |
| 36 | R0360 | | | | | |
| 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 | | |
| 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 | |
| SCR | | |
| Sterblichkeitsrisikostress zum Zweck der Matching-Anpassung | R0070 | |
| Portfolio | | |
| 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 | |

| | | C0010 |
|---|--------------|-------|
| Marktwert rückgekaufter Verträge | R0130 | |
| Anzahl der ausgeübten Rückkaufoptionen | R0140 | |
| Marktwert von Vermögenswerten, die rückgekaufte Verträge bedecken | R0150 | |
| An Versicherungsnehmer ausgezahlter Betrag | R0160 | |
| Verbindlichkeiten | | X |
| Laufzeit/Duration | R0170 | |

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

| Währung | Z0010 | |
|--|--------------|---|
| | | Anpassung an den risikofreien Zinssatz |
| | | 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 | | Besten 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 8,0 % | R0210 | | | |

S.22.05.01

Gesamtberechnung bei Anwendung der Übergangsmaßnahme bei versicherungstechnischen Rückstellungen

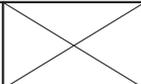
| | | C0010 |
|--|--------------|-------|
| Versicherungstechnische Rückstellungen nach Solvabilität II am ersten Tag | R0010 | |
| Versicherungstechnische Rückstellungen im Falle der Übergangsmaßnahme bei versicherungstechnischen Rückstellungen | | X |
| Versicherungstechnische Rückstellungen als Ganzes 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 | |
| Andere Währung als Berichtswährung | R0010 | ... |

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

| | | | Gesamtwert des besten Schätzwerts im Falle einer Volatilitätsanpassung (für alle Währungen) | Anteil des besten Schätzwerts im Falle einer Volatilitätsanpassung in der Berichtswährung | Anteil des besten Schätzwerts im Falle einer Volatilitätsanpassung nach Währungen | |
|---|-------|--|---|---|---|-----|
| | | | C0030 | C0040 | C0050 | ... |
| Gesamtwert des besten Schätzwerts im Falle einer Volatilitätsanpassung in allen Ländern | R0020 |  | | | | |
| Gesamtwert des besten Schätzwerts im Falle einer Volatilitätsanpassung im Herkunftsland | R0030 |  | | | | |

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

| | | Land | Gesamtwert des besten Schätzwerts im Falle einer Volatilitätsanpassung (für alle Währungen) | Anteil des besten Schätzwerts im Falle einer Volatilitätsanpassung in der Berichtswährung | Anteil des besten Schätzwerts im Falle einer Volatilitätsanpassung nach Währungen | |
|---|-------|-------|---|---|---|-----|
| | | C0020 | C0030 | C0040 | C0050 | ... |
| Gesamtwert des besten Schätzwerts im Falle einer Volatilitätsanpassung in anderen Ländern als dem Herkunftsland | R0040 | | | | | |
| ... | | | | | | |