

S.33.01 — Anforderungen für Versicherungs- und Rückversicherungsunternehmen auf Einzelebene

Allgemeine Bemerkungen:

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

Dieser Meldebogen ist auszufüllen, wenn die in Artikel 230 der Richtlinie 2009/138/EG festgelegte Methode 1, die in Artikel 233 der Richtlinie 2009/138/EG festgelegte Methode 2 und eine Kombination der Methoden wie nachstehend verwendet werden.

- Der erste Teil (Zellen C0060 bis C0230) erfasst Informationen über alle Versicherungs- und Rückversicherungsunternehmen der Gruppe aus EWR- und Nicht-EWR-Ländern unter Anwendung der Richtlinie 2009/138/EG, die gemäß den darin enthaltenen Vorschriften vorgelegt werden, unabhängig davon, welche Methode für die Berechnung der Gruppensolvabilität verwendet wird.
- Der zweite Teil (Zellen C0240 bis C0260) erfasst Informationen über die lokalen Kapitalanforderungen, lokalen Mindestkapitalanforderungen und anrechnungsfähigen Eigenmittel aller Nicht-EWR-Versicherungs- und Rückversicherungsunternehmen der Gruppe; diese Angaben sind gemäß den lokalen Regelungen unabhängig von der verwendeten Methode zur Berechnung der Gruppensolvabilität vorzulegen.
- In der letzten Zelle C0270 werden die Informationen über den Einzelbeitrag aller Versicherungs- und Rückversicherungsunternehmen innerhalb und außerhalb des EWR zur SCR für die Gruppe erfasst.
- Zweck der in diesem Meldebogen enthaltenen Daten ist es, den Aufsichtsbehörden Informationen zur Verfügung zu stellen, die die Bewertung der Verfügbarkeit von Eigenmitteln verbessern und die Bewertung der Höhe der Diversifikationseffekte erleichtern.

	ELEMENT	HINWEISE
C0010	Eingetragener Name des Unternehmens	Eingetragener Name des einzelnen Unternehmens
C0020	Identifikationscode des Unternehmens	<p>Identifikationscode in dieser Rangfolge:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Rechtsträgerkennung (LEI), verpflichtend, sofern vorhanden; — Spezifischer Code in Ermangelung einer Rechtsträgerkennung. <p>Spezifischer Code:</p> <ul style="list-style-type: none"> — Für der Aufsicht unterliegende Unternehmen mit Sitz im EWR, bei denen es sich nicht um Versicherungs- und Rückversicherungsunternehmen handelt, die in die Gruppenaufsicht einbezogen sind, der auf dem lokalen Markt verwendete Identifikationscode, der durch die Aufsichtsbehörde des Unternehmens zugewiesen wird; — 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>Identifikationscode des Mutterunternehmens + ISO 3166-1 Alpha-2-Code des Landes des Unternehmens + fünfstellige Zahl</p>
C0030	Art des ID-Codes des Unternehmens	<p>Art des im Element „Identifikationscode des Unternehmens“ angegebenen Codes.</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — Rechtsträgerkennung (LEI) 2 — Spezifischer Code
C0040	Ebene der Einheit/Sonderverband oder MAP/übriger Teil	<p>Angabe, worauf sich die Informationen beziehen. Bitte treffen Sie eine Auswahl aus folgender erschöpfender Liste:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1 — Ebene der Einheit 2 — Wesentlicher Sonderverband oder wesentliches Matching-Adjustment-Portfolio 3 — Übriger Teil
C0050	Fondsnummer	<p>Wenn C0040 = 2, ist dies die von der Gruppe vergebene einmalige Nummer für den wesentlichen Sonderverband oder das wesentliche Matching-Adjustment-Portfolio. Sie bleibt im Zeitverlauf unverändert. Sie darf für keine anderen Fonds oder Portfolios wiederverwendet werden. Die Nummer ist auf allen Meldebögen durchgängig zu verwenden, sofern sie zur Identifikation des Fonds/Portfolios erforderlich ist.</p> <p>Wenn C0040 = 1 oder 3, ist „0“ einzutragen.</p>
	Versicherungs- und Rückversicherungsunternehmen innerhalb und außerhalb des EWR (bei Anwendung von Solvabilität-II-Vorschriften)	

	ELEMENT	HINWEISE
C0060	SCR Marktrisiko	SCR Marktrisiko auf Einzelebene (brutto) für jedes Unternehmen
C0070	SCR Gegenparteiausfallrisiko	SCR Gegenparteiausfallrisiko auf Einzelebene (brutto) für jedes Unternehmen.
C0080	SCR lebensversicherungstechnisches Risiko	SCR lebensversicherungstechnisches Risiko auf Einzelebene (brutto) für jedes Unternehmen.
C0090	SCR krankensicherungstechnisches Risiko	SCR krankensicherungstechnisches Risiko auf Einzelebene (brutto) für jedes Unternehmen.
C0100	SCR nichtlebensversicherungstechnisches Risiko	SCR nichtlebensversicherungstechnisches Risiko auf Einzelebene (brutto) für jedes Unternehmen.
C0110	SCR operationelles Risiko	SCR operationelles Risiko auf Einzelebene für jedes Unternehmen.
C0120	SCR auf Einzelebene	SCR auf Einzelebene für jedes Unternehmen (einschließlich Kapitalaufschlag).
C0130	MCR auf Einzelebene	MCR auf Einzelebene für jedes Unternehmen.
C0140	Anrechnungsfähige Eigenmittel auf Einzelebene zur Deckung der SCR	Anrechnungsfähige Eigenmittel auf Einzelebene zur Deckung der SCR. In diesem Element sind die gesamten Eigenmittel anzugeben. Es bestehen keine Einschränkungen bezüglich der Verfügbarkeit für die Gruppe.
C0150	Verwendung unternehmensspezifischer Parameter	<p>Wenn ein Unternehmen unternehmensspezifische Parameter zur Berechnung der SCR auf Einzelebene verwendet, sind der Bereich/die Bereiche anzugeben, für den/die diese Parameter verwendet werden. Bitte treffen Sie eine Auswahl aus folgender erschöpfender Liste:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Lebensversicherungstechnisches Risiko/Revisionsrisiko 2 — Krankensicherungstechnisches Risiko nach Art der Lebensversicherung/Revisionsrisiko 3 — Prämien- und Rückstellungsrisko Kranken nach Art der Nichtleben 4 — Prämien- und Rückstellungsrisko Nichtleben <p>Es sind so viele Optionen wie nötig durch Kommas (,) getrennt anzugeben.</p>

	ELEMENT	HINWEISE
C0160	Verwendung von Vereinfachungen	<p>Wenn ein Unternehmen Vereinfachungen zur Berechnung der SCR auf Einzel-ebene verwendet, sind der Bereich/die Bereiche anzugeben, für den/die diese Vereinfachungen verwendet werden. Bitte treffen Sie eine Auswahl aus folgender erschöpfender Liste:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Marktrisiko/Spread-Risiko (Anleihen und Darlehen) 2 — Marktrisiko/Zinsrisiko (firmeneigene Versicherungsunternehmen) 3 — Marktrisiko/Spread-Risiko (Anleihen und Darlehen) (firmeneigene Versicherungsunternehmen) 4 — Marktrisiko/Marktrisikokonzentration (firmeneigene Versicherungsunternehmen) 5 — Gegenparteausfallrisiko 6 — Lebensversicherungstechnisches Risiko/Sterblichkeitsrisiko 7 — Lebensversicherungstechnisches Risiko/Langlebigkeitsrisiko 8 — Lebensversicherungstechnisches Risiko/Invaliditäts-/Morbiditätsrisiko 9 — Lebensversicherungstechnisches Risiko/Stornorisiko 10 — Lebensversicherungstechnisches Risiko/Lebensversicherungskostenrisiko 11 — Lebensversicherungstechnisches Risiko/Lebensversicherungskatastrophenrisiko 12 — Krankenversicherungstechnisches Risiko/Sterblichkeitsrisiko 13 — Krankenversicherungstechnisches Risiko/Langlebigkeitsrisiko 14 — Krankenversicherungstechnisches Risiko/Invaliditäts-/Morbiditätsrisiko (Krankheitskosten) 15 — Krankenversicherungstechnisches Risiko/Invaliditäts-/Morbiditätsrisiko (Einkommensersatz) 16 — Krankenversicherungstechnisches Risiko nach Art der Lebensversicherung/Stornorisiko 17 — Krankenversicherungstechnisches Risiko/Lebensversicherungskostenrisiko 18 — Nichtlebensversicherungstechnisches Risiko/Prämien- und Rückstellungsrisiko (firmeneigene Versicherungsunternehmen) <p>Es sind so viele Optionen wie nötig durch Kommas (,) getrennt anzugeben.</p>
C0170	Verwendung des internen Partialmodells	<p>Wenn ein Unternehmen interne Partialmodelle zur Berechnung der SCR auf Einzel-ebene verwendet, sind der Bereich/die Bereiche anzugeben, für den/die sie verwendet werden.</p>
C0180	Internes Modell auf Gruppen- oder Einzel-ebene	<p>Wenn ein Unternehmen ein internes Vollmodell zur Berechnung der SCR auf Einzel-ebene verwendet, ist anzugeben, ob dies ein internes Modell auf Einzel-oder auf Gruppenebene betrifft. Bitte treffen Sie eine Auswahl aus folgender erschöpfender Liste:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Internes Modell auf Einzel-ebene 2 — Internes Modell auf Gruppenebene

	ELEMENT	HINWEISE
C0190	Datum der Erstgenehmigung des internen Modells	Wenn eine Aufsichtsbehörde eine Genehmigung für ein internes Modell auf Gruppen- oder Einzelebene erteilt, ist der ISO-8601-Code (JJJJ-MM-TT) des Datums dieser Genehmigung anzugeben.
C0200	Datum der Genehmigung der letzten wesentlichen Änderung des internen Modells	Wenn eine Aufsichtsbehörde eine Genehmigung für eine wesentliche Änderung des internen Modells auf Gruppen- oder Einzelebene erteilt (Artikel 115), ist der ISO-8601-Code (JJJJ-MM-TT) des Datums dieser Genehmigung anzugeben.
C0210	Datum der Festsetzung eines Kapitalaufschlags	Bei der Festsetzung eines Kapitalaufschlags für eines der hier aufgeführten Unternehmen (Artikel 37 der Richtlinie 2009/138/EG) ist der ISO-8601-Code (JJJJ-MM-TT) des Datums der Festsetzung anzugeben.
C0220	Betrag des Kapitalaufschlags	Bei der Festsetzung eines Kapitalaufschlags für eine der hier aufgeführten Einheiten (Artikel 37 der Richtlinie 2009/138/EG) ist hier der genaue Betrag anzugeben.
C0230	Grund des Kapitalaufschlags	Bei der Festsetzung eines Kapitalaufschlags für eines der hier aufgeführten Unternehmen (Artikel 37 der Richtlinie 2009/138/EG) ist hier der von der Aufsichtsbehörde genannte Grund für diese Entscheidung anzugeben.
	<i>Versicherungs- und Rückversicherungsunternehmen außerhalb des EWR (bei Anwendung oder Nichtanwendung der Solvabilität-II-Regelungen), unabhängig von der gewählten Methode</i>	
C0240	Lokale Kapitalanforderung	Lokale Kapitalanforderung auf Einzelebene, die ein erstes Eingreifen der nationalen Aufsichtsbehörde auslöst.
C0250	Lokale Mindestkapitalanforderung	Lokale Mindestkapitalanforderung auf Einzelebene, die ein ultimates Eingreifen der nationalen Aufsichtsbehörde (Entzug der Zulassung) auslöst. Diese Angabe dient der Berechnung des Mindestbetrags der konsolidierten SCR für die Gruppe.

	ELEMENT	HINWEISE
C0260	Anrechnungsfähige Eigenmittel gemäß lokalen Regelungen	Anrechnungsfähige Eigenmittel auf Einzelebene zur Deckung der lokalen Kapitalanforderung, berechnet nach lokalen Regelungen und ohne Anwendung der Einschränkungen bezüglich der Verfügbarkeit für die Gruppe.
C0270	Beitrag der SCR auf Einzelebene zur SCR auf Gruppenebene	<p>Beitrag der SCR auf Einzelebene zur SCR auf Gruppenebene</p> <p>Bei Verwendung von Methode 1 wird der Beitrag eines Tochterunternehmens zur SCR für die Gruppe nach folgender Formel berechnet:</p> $\text{Contr}_j = \text{SCR}_j \times \text{SCR}_{\text{diversified}} / \sum_i \text{SCR}_{\text{isolo}}$ <p>Dabei gilt:</p> <ul style="list-style-type: none"> — SCR_j ist die SCR des Unternehmens j auf Einzelebene; — SCR_{diversified} = gemäß Artikel 336 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/35 berechnete SCR; — SCR_{isolo} ist die auf Ebene des einzelnen Unternehmens ermittelte SCR des beteiligten Unternehmens und aller verbundenen Versicherungs- oder Rückversicherungsunternehmen sowie Drittlandsversicherungs- und -rückversicherungsunternehmen, die in die Berechnung von SCR_{diversified} einbezogen werden; — das Verhältnis ist die proportionale Anpassung aufgrund der Erfassung von Diversifikationseffekten auf Gruppenebene. <p>Für verbundene Versicherungs- und Rückversicherungsunternehmen, die keine Tochterunternehmen sind (Artikel 335 Absatz 1 Buchstabe d der Delegierten Verordnung) und nach Methode 1 einbezogen werden, ist der Beitrag des verbundenen Unternehmens zur SCR für die Gruppe der proportionale Anteil der SCR auf Einzelebene.</p> <p>Bei Methode 2 ist der Beitrag des verbundenen Unternehmens zur SCR für die Gruppe der verhältnismäßige Anteil der SCR auf Einzelebene.</p>