

S.34.01 — Anforderungen für andere der Aufsicht bzw. nicht der Aufsicht unterliegende Finanzunternehmen, einschließlich Versicherungsholdinggesellschaften und gemischte Finanzholdinggesellschaften, 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 verwendet werden. Er umfasst die Anforderungen auf Einzelebene für Finanzunternehmen, die keine Versicherungs- und Rückversicherungsunternehmen sind, und nicht der Aufsicht unterliegende Unternehmen, die Finanzgeschäfte gemäß Artikel 1 Absatz 52 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/35 tätigen, wie Kreditinstitute, Wertpapierfirmen und Finanzinstitute, Verwalter alternativer Investmentfonds, OGAW-Verwaltungsgesellschaften, Einrichtungen der betrieblichen Altersversorgung, nicht regulierte Unternehmen, die Finanzgeschäfte tätigen, Versicherungsholdinggesellschaften und gemischte Finanzholdinggesellschaften.

	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: Identifikationscode des Mutterunternehmens + ISO 3166-1 Alpha-2-Code des Landes des Unternehmens + fünfstellige Zahl
C0030	Art des ID-Codes des Unternehmens	<p>Art des im Element „Identifikationscode des Unternehmens“ angegebenen Codes.</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Rechtsträgerkennung (LEI) 2 — Spezifischer Code
C0040	Aggregiert oder nicht	<p>Wenn die Einheiten in anderen Finanzbranchen eine Gruppe mit einer spezifischen Kapitalanforderung bilden, kann anstelle der Liste der Anforderungen auf Einzelebene diese konsolidierte Kapitalanforderung anerkannt werden. Bitte treffen Sie eine Auswahl aus folgender erschöpfender Liste:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Aggregiert 2 — Nicht aggregiert
C0050	Art der Kapitalanforderung	<p>Geben Sie die Art der Kapitalanforderung an. Bitte treffen Sie eine Auswahl aus folgender erschöpfender Liste:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1 — Sektorbezogen (für Kreditinstitute, Wertpapierfirmen, Finanzinstitute, Verwalter alternativer Investmentfonds, OGAW-Verwaltungsgesellschaften, Einrichtungen der betrieblichen Altersversorgung) 2 — Fiktiv (für nicht der Aufsicht unterliegende Unternehmen) 3 — Keine Kapitalanforderung
C0060	Fiktive SCR oder sektorbezogene Kapitalanforderung	<p>Dies ist die sektorbezogene oder fiktive Kapitalanforderung, die nach Maßgabe der „Aufsichtshierarchie“ ein erstes Eingreifen durch die Aufsichtsbehörde auf Einzelebene erfordert.</p>

	ELEMENT	HINWEISE
C0070	Fiktive oder sektorbezogene Mindestkapitalanforderung	<p>Dies ist die sektorbezogene oder fiktive Kapitalanforderung, die nach Maßgabe der „Aufsichtshierarchie“ ein ultimatives Eingreifen durch die Aufsichtsbehörde auf Einzelebene auslöst.</p> <p>Diese Angabe ist nicht für Einheiten erforderlich, für die keine ultimative Auslöseschwelle festgelegt wurde.</p>
C0080	Fiktive oder sektorbezogene anrechnungsfähige Eigenmittel	Gesamtbetrag der Eigenmittel zur Bedeckung der (fiktiven oder sektorbezogenen) Kapitalanforderung. Es bestehen keine Einschränkungen bezüglich der Verfügbarkeit für die Gruppe.
C0085	Beitrag der (nominalen) SCR auf Einzelebene zur SCR für die Gruppe	<p>Beitrag der nominalen Solo-SCR zur Gruppen-SCR für Versicherungsholdinggesellschaften und gemischte Finanzholdinggesellschaften</p> <p>Beitrag der SCR auf Einzelebene zur SCR auf Gruppenebene</p> <p>Bei Verwendung von Methode 1 wird der Beitrag eines Tochterunternehmens zur Gruppe nach folgender Formel berechnet:</p> $\text{Contrj} = \text{SCRj} \times \text{SCRdiversified} / \sum \text{SCRisolo}$ <p>Dabei gilt:</p> <ul style="list-style-type: none"> — SCRj ist die SCR des Unternehmens j auf Einzelebene; — SCRdiversified = gemäß Artikel 336 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2015/35 der Kommission berechnete SCR; — SCRisolo ist die auf Ebene des einzelnen Unternehmens ermittelte SCR des beteiligten Unternehmens und aller verbundenen Versicherungs- oder <p>Rückversicherungsunternehmen sowie Drittlandsversicherungs- und -rückversicherungsunternehmen, die in die Berechnung von SCRdiversified einbezogen werden;</p> <ul style="list-style-type: none"> — das Verhältnis ist die proportionale Anpassung aufgrund der Erfassung von Diversifikationseffekten auf Gruppenebene. <p>Für verbundene Unternehmen, 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>