

Bericht

über Solvabilität und Finanzlage

Anhang

zum Stichtag 31.12.2019

2019

Anhang: Meldebögen

- a) Meldebogen S.02.01.02 zur Angabe von Bilanzinformationen unter Verwendung der Bewertung im Einklang mit Artikel 75 der Richtlinie 2009/138/EG
- b) Meldebogen S.23.01.01 zur Angabe von Informationen über Eigenmittel, einschließlich Basiseigenmitteln und ergänzenden Eigenmitteln
- c) Meldebogen S.25.01.21 zur Angabe von Informationen über die unter Anwendung der Standardformel berechnete Solvenzkapitalanforderung

Anhang I
S.02.01.02 in Tausend €
Bilanz

		Solvabilität-II- Wert
		C0010
Vermögenswerte	R0030	
Immaterielle Vermögenswerte	R0040	267.528
Latente Steueransprüche	R0050	
Überschuss bei den Altersversorgungsleistungen	R0060	53
Immobilien, Sachanlagen und Vorräte für den Eigenbedarf	R0070	5.906.061
Anlagen (außer Vermögenswerten für indexgebundene und fondsgebundene Verträge)	R0080	86.713
Immobilien (außer zur Eigennutzung)	R0090	166.216
Anteile an verbundenen Unternehmen, einschließlich Beteiligungen	R0100	18.658
Aktien	R0110	
Aktien – notiert	R0120	18.658
Aktien – nicht notiert	R0130	4.139.972
Anleihen	R0140	1.332.961
Staatsanleihen	R0150	2.807.012
Unternehmensanleihen	R0160	
Strukturierte Schuldtitel	R0170	
Besicherte Wertpapiere	R0180	1.494.502
Organismen für gemeinsame Anlagen	R0190	
Derivate	R0200	
Einlagen außer Zahlungsmitteläquivalenten	R0210	
Sonstige Anlagen	R0220	
Vermögenswerte für index- und fondsgebundene Verträge	R0230	232.443
Darlehen und Hypotheken	R0240	
Policendarlehen	R0250	172.054
Darlehen und Hypotheken an Privatpersonen	R0260	60.390
Sonstige Darlehen und Hypotheken	R0270	0
Einforderbare Beträge aus Rückversicherungsverträgen von:	R0280	0
Nichtlebensversicherungen und nach Art der Nichtlebensversicherung betriebenen Krankenversicherungen	R0290	
Nichtlebensversicherungen außer Krankenversicherungen	R0300	0
nach Art der Nichtlebensversicherung betriebenen Krankenversicherungen	R0310	0
Lebensversicherungen und nach Art der Lebensversicherung betriebenen Krankenversicherungen außer Krankenversicherungen und fonds- und indexgebundenen Versicherungen	R0320	0
nach Art der Lebensversicherung betriebenen Krankenversicherungen	R0330	
Lebensversicherungen außer Krankenversicherungen und fonds- und indexgebundenen Versicherungen	R0340	
Lebensversicherungen, fonds- und indexgebunden	R0350	
Depotforderungen	R0360	2.185
Forderungen gegenüber Versicherungen und Vermittlern	R0370	
Forderungen gegenüber Rückversicherern	R0380	
Forderungen (Handel, nicht Versicherung)	R0390	
Eigene Anteile (direkt gehalten)	R0400	
In Bezug auf Eigenmittelbestandteile fällige Beträge oder ursprünglich eingeforderte, aber noch nicht eingezahlte Mittel	R0410	7.980
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente	R0420	17.996
Sonstige nicht an anderer Stelle ausgewiesene Vermögenswerte	R0500	6.434.246
Vermögenswerte insgesamt		

S.02.01.02 in Tausend €**Bilanz**

		Solvabilität-II- Wert
		C0010
Verbindlichkeiten		
Versicherungstechnische Rückstellungen – Nichtlebensversicherung	R0510	1.950
Versicherungstechnische Rückstellungen – Nichtlebensversicherung (außer Krankenversicherung)	R0520	
Versicherungstechnische Rückstellungen als Ganzes berechnet	R0530	
Bester Schätzwert	R0540	
Risikomarge	R0550	
Versicherungstechnische Rückstellungen – Krankenversicherung (nach Art der Nichtlebensversicherung)	R0560	1.950
Versicherungstechnische Rückstellungen als Ganzes berechnet	R0570	
Bester Schätzwert	R0580	810
Risikomarge	R0590	1.140
Versicherungstechnische Rückstellungen – Lebensversicherung (außer fonds- und indexgebundenen Versicherungen)	R0600	5.600.441
Versicherungstechnische Rückstellungen – Krankenversicherung (nach Art der Lebensversicherung)	R0610	5.600.441
Versicherungstechnische Rückstellungen als Ganzes berechnet	R0620	
Bester Schätzwert	R0630	5.376.243
Risikomarge	R0640	224.198
Versicherungstechnische Rückstellungen – Lebensversicherung (au- ßer Krankenversicherungen und fonds- und indexgebundenen Versiche- rungen)	R0650	
Versicherungstechnische Rückstellungen als Ganzes berechnet	R0660	
Bester Schätzwert	R0670	
Risikomarge	R0680	
Versicherungstechnische Rückstellungen – fonds- und indexgebundene Versicherungen	R0690	
Versicherungstechnische Rückstellungen als Ganzes berechnet	R0700	
Bester Schätzwert	R0710	
Risikomarge	R0720	
Eventualverbindlichkeiten	R0740	3.472
Andere Rückstellungen als versicherungstechnische Rückstellungen	R0750	25.409
Rentenzahlungsverpflichtungen	R0760	34.317
Depotverbindlichkeiten	R0770	
Latente Steuerschulden	R0780	287.688
Derivate	R0790	
Verbindlichkeiten gegenüber Kreditinstituten	R0800	
Finanzielle Verbindlichkeiten außer Verbindlichkeiten gegenüber Kreditin- stituten	R0810	
Verbindlichkeiten gegenüber Versicherungen und Vermittlern	R0820	3.415
Verbindlichkeiten gegenüber Rückversicherern	R0830	44
Verbindlichkeiten (Handel, nicht Versicherung)	R0840	
Nachrangige Verbindlichkeiten	R0850	
Nicht in den Basiseigenmitteln aufgeführte nachrangige Verbindlichkei- ten	R0860	
In den Basiseigenmitteln aufgeführte nachrangige Verbindlichkeiten	R0870	
Sonstige nicht an anderer Stelle ausgewiesene Verbindlichkeiten	R0880	1.911
Verbindlichkeiten insgesamt	R0900	5.958.649
Überschuss der Vermögenswerte über die Verbindlichkeiten	R1000	475.597

S.23.01.01 in Tausend €
Eigenmittel

		Gesamt	Tier 1 – nicht gebunden	Tier 1 – gebunden	Tier 2	Tier 3
		C0010	C0020	C0030	C0040	C0050
Basiseigenmittel vor Abzug von Beteiligungen an anderen Finanzbranchen im Sinne von Artikel 68 der Delegierten Verordnung (EU) 2015/35						
Grundkapital (ohne Abzug eigener Anteile)	R0010					
Auf Grundkapital entfallendes Emissionsagio	R0030					
Gründungsstock, Mitgliederbeiträge oder entsprechender Basiseigenmittelbestandteil bei Versicherungsvereinen auf Gegenseitigkeit und diesen ähnlichen Unternehmen	R0040					
Nachrangige Mitgliederkonten von Versicherungsvereinen auf Gegenseitigkeit	R0050					
Überschussfonds	R0070	125.383	125.383			
Vorzugsaktien	R0090					
Auf Vorzugsaktien entfallendes Emissionsagio	R0110					
Ausgleichsrücklage	R0130	350.214	350.214			
Nachrangige Verbindlichkeiten	R0140					
Betrag in Höhe des Werts der latenten Netto-Steueransprüche	R0160	0				0
Sonstige, oben nicht aufgeführte Eigenmittelbestandteile, die von der Aufsichtsbehörde als Basiseigenmittel genehmigt wurden	R0180					
Im Jahresabschluss ausgewiesene Eigenmittel, die nicht in die Ausgleichsrücklage eingehen und die die Kriterien für die Einstufung als Solvabilität-II-Eigenmittel nicht erfüllen						
Im Jahresabschluss ausgewiesene Eigenmittel, die nicht in die Ausgleichsrücklage eingehen und die die Kriterien für die Einstufung als Solvabilität-II-Eigenmittel nicht erfüllen	R0220					
Abzüge						
Abzug für Beteiligungen an Finanz- und Kreditinstituten	R0230					
Gesamtbetrag der Basiseigenmittel nach Abzügen	R0290	475.597	475.597			0
Ergänzende Eigenmittel						
Nicht eingezahltes und nicht eingefordertes Grundkapital, das auf Verlangen eingefordert werden kann	R0300					
Gründungsstock, Mitgliederbeiträge oder entsprechender Basiseigenmittelbestandteil bei Versicherungsvereinen auf Gegenseitigkeit und diesen ähnlichen Unternehmen, die nicht eingezahlt und nicht eingefordert wurden, aber auf Verlangen eingefordert werden können	R0310					
Nicht eingezahlte und nicht eingeforderte Vorzugsaktien, die auf Verlangen eingefordert werden können	R0320					
Eine rechtsverbindliche Verpflichtung, auf Verlangen nachrangige Verbindlichkeiten zu zeichnen und zu begleichen	R0330					
Kreditbriefe und Garantien gemäß Artikel 96 Absatz 2 der Richtlinie 2009/138/EG	R0340					
Andere Kreditbriefe und Garantien als solche nach Artikel 96 Absatz 2 der Richtlinie 2009/138/EG	R0350					
Aufforderungen an die Mitglieder zur Nachzahlung gemäß Artikel 96 Absatz 3 Unterabsatz 1 der Richtlinie 2009/138/EG	R0360					

S.23.01.01 in Tausend €
Eigenmittel

		Gesamt	Tier 1 – nicht gebunden	Tier 1 – gebunden	Tier 2	Tier 3
		C0010	C0020	C0030	C0040	C0050
Aufforderungen an die Mitglieder zur Nachzahlung – andere als solche gemäß Artikel 96 Absatz 3 Unterabsatz 1 der Richtlinie 2009/138/EG	R0370					
Sonstige ergänzende Eigenmittel	R0390					
Ergänzende Eigenmittel gesamt	R0400					
Zur Verfügung stehende und anrechnungsfähige Eigenmittel						
Gesamtbetrag der zur Erfüllung der SCR zur Verfügung stehenden Eigenmittel	R0500	475.597	475.597			0
Gesamtbetrag der zur Erfüllung der MCR zur Verfügung stehenden Eigenmittel	R0510	475.597	475.597			
Gesamtbetrag der zur Erfüllung der SCR anrechnungsfähigen Eigenmittel	R0540	475.597	475.597	0	0	0
Gesamtbetrag der zur Erfüllung der MCR anrechnungsfähigen Eigenmittel	R0550	475.597	475.597	0	0	
SCR	R0580	63.340				
MCR	R0600	28.503				
Verhältnis von anrechnungsfähigen Eigenmitteln zur SCR	R0620	7,5086				
Verhältnis von anrechnungsfähigen Eigenmitteln zur MCR	R0640	16,6857				
		C0060				
Ausgleichsrücklage						
Überschuss der Vermögenswerte über die Verbindlichkeiten	R0700	475.597				
Eigene Anteile (direkt und indirekt gehalten)	R0710					
Vorhersehbare Dividenden, Ausschüttungen und Entgelte	R0720					
Sonstige Basiseigenmittelbestandteile	R0730	125.383				
Anpassung für gebundene Eigenmittelbestandteile in Matching-Adjustment-Portfolios und Sonderverbänden	R0740					
Ausgleichsrücklage	R0760	350.214				
Erwartete Gewinne						
Bei künftigen Prämien einkalkulierter erwarteter Gewinn (EPIFP) – Lebensversicherung	R0770	158.672				
Bei künftigen Prämien einkalkulierter erwarteter Gewinn (EPIFP) – Nichtlebensversicherung	R0780	-163				
Gesamtbetrag des bei künftigen Prämien einkalkulierten erwarteten Gewinns (EPIFP)	R0790	158.510				

S.25.01.21 in Tausend €

Solvenzkapitalanforderung – für Unternehmen, die die Standardformel verwenden

		Brutto-Solvenzkapitalanforderung	USP	Vereinfachungen
		C0110	C0090	C0120
Marktrisiko	R0010	212.086		
Gegenparteiausfallrisiko	R0020	19.857		
Lebensversicherungstechnisches Risiko	R0030			
Krankenversicherungstechnisches Risiko	R0040	225.323		
Nichtlebensversicherungstechnisches Risiko	R0050			
Diversifikation	R0060	-104.588		
Risiko immaterieller Vermögenswerte	R0070	0		
Basissolvenzkapitalanforderung	R0100	352.678		
Berechnung der Solvenzkapitalanforderung		C0100		
Operationelles Risiko	R0130	24.529		
Verlustausgleichsfähigkeit der versicherungstechnischen Rückstellungen	R0140	-284.957		
Verlustausgleichsfähigkeit der latenten Steuern	R0150	-28.909		
Kapitalanforderung für Geschäfte nach Artikel 4 der Richtlinie 2003/41/EG	R0160			
Solvenzkapitalanforderung ohne Kapitalaufschlag	R0200	63.340		
Kapitalaufschlag bereits festgesetzt	R0210			
Solvenzkapitalanforderung	R0220	63.340		
Weitere Angaben zur SCR				
Kapitalanforderung für das durationsbasierte Untermodul Aktienrisiko	R0400			
Gesamtbetrag der fiktiven Solvenzkapitalanforderung für den übrigen Teil	R0410			
Gesamtbetrag der fiktiven Solvenzkapitalanforderungen für Sonderverbände	R0420			
Gesamtbetrag der fiktiven Solvenzkapitalanforderungen für Matching-Adjustment-Portfolios	R0430			
Diversifikationseffekte aufgrund der Aggregation der fiktiven Solvenzkapitalanforderung für Sonderverbände nach Artikel 304	R0440			